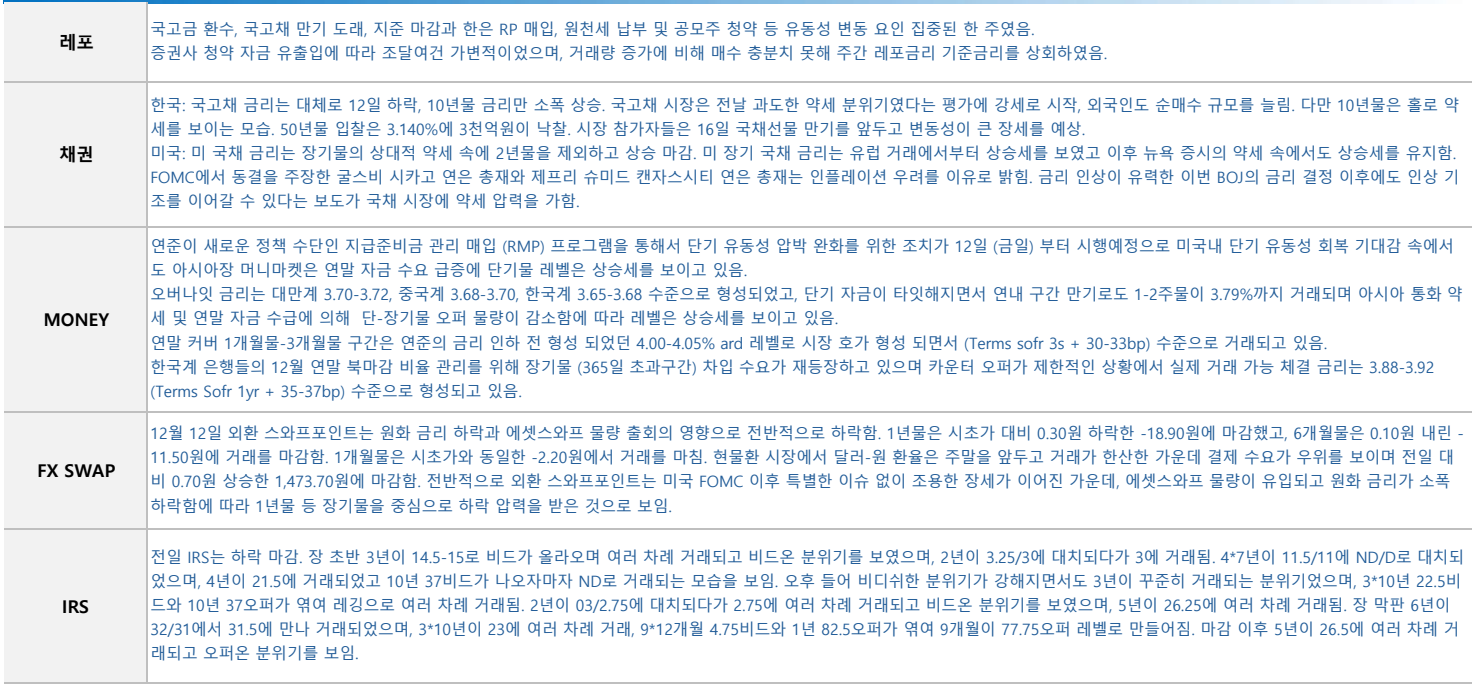


2025.12.15(월)



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	
2025.12.08(월)	268.7	217.5	2.52%	2.520%	2.50%	2.83%	2년물	3.524%	-1.80
2025.12.09(화)	272.2	217.2	2.55%	2.513%		2.83%	5년물	3.743%	0.70
2025.12.10(수)	273.4	214.9	2.55%	2.485%		2.83%	10년물	4.186%	2.70
2025.12.11(목)	273.0	216.0	2.54%	2.518%		2.83%	30년물	4.847%	4.50
2025.12.12(금)	279.3		2.54%	2.533%		2.83%	10Y-2Y	66.2	0.04

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금부협 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	4,167.16	56.54	27.12.10	국고 24-12	1,722	은행채 2,000	은행채 300	국고채 10년 10,000억원 입찰
KOSDAQ	937.34	2.70	74.09.10	국고 24-11	1,480	여전채 11,600	여전채 1,450	통안채 91일물 6,000억원 입찰
달러-원	1,477.00원	5.10원	55.09.10	국고 25-7	1,320	회사채 35	회사채 2,550	
국고3Y	3.093%	-0.8	1900.01.00(토)	0	0		공사채 1,500	
국고10Y	3.409%	3.1	1900.01.00(토)	0	0			
국고10Y-3Y	31.6	3.9	1900.01.00(토)	0	0			

Money Market Closing									단위 : %, %p
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	
O/N	3.71	3.65	3.68	0.03	O/N	3.73	3.65	3.70	0.05
T/N	3.73	3.67	3.70	0.03	T/N	3.73	3.65	3.70	0.05
1W	3.80	3.70	3.75	0.00	1W	3.75	3.65	3.73	0.01
1S	4.05	3.95	4.00	0.04	1S	3.93	3.78	3.90	0.00
3S	4.05	3.95	3.99	0.02	3S	3.93	3.78	3.90	0.02
6S	4.05	3.90	3.98	-0.01	6S	3.88	3.73	3.85	0.00
1YR	3.95	3.80	3.89	-0.01	1YR	3.80	3.65	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	-19/-15	-17	3.88	-0.33	2.50	3.90000	1M MAR	-237	-233
T/N	-7/-3	-5	3.73	-0.24	2.50	3.89517	1W*1S	-168	-162
1W	-47/-41	-44	4.04	-0.01	2.50	3.86616	1*2	-228	-218
1S	-225/-215	-220	4.36	0.01	2.62	3.75012	1*3	-380	-370
3S	-630/-610	-620	4.53	0.03	2.83	3.72320	1*6	-903	-883
6S	-1180/-1120	-1150	4.50	0.01	2.92	3.66729	1*9	-1308	-1278
1YR	-1940/-1840	-1890	4.20	0.02	2.88	3.52839	1*12	-1613	-1583

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)

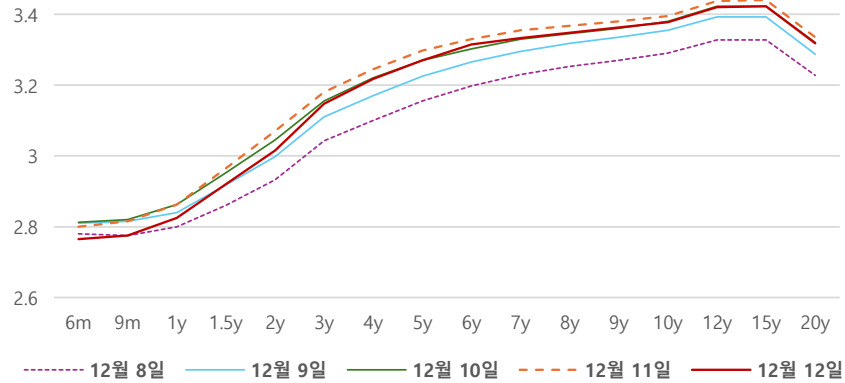
IRS 데일리 증가

12월 12일

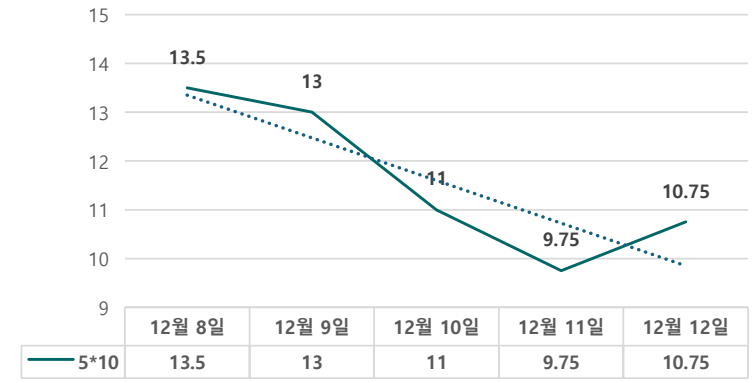
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	2.7650	-3.50
9m	2.7750	-4.00
1y	2.8250	-3.75
1.5y	2.9200	-4.50
2y	3.0150	-5.50
3y	3.1475	-3.25
4y	3.2175	-2.75
5y	3.2700	-2.75
6y	3.3150	-1.50
7y	3.3325	-2.25
8y	3.3475	-2.00
9y	3.3625	-1.75
10y	3.3775	-1.75
12y	3.4200	-1.75
15y	3.4225	-1.75
20y	3.3175	-1.75

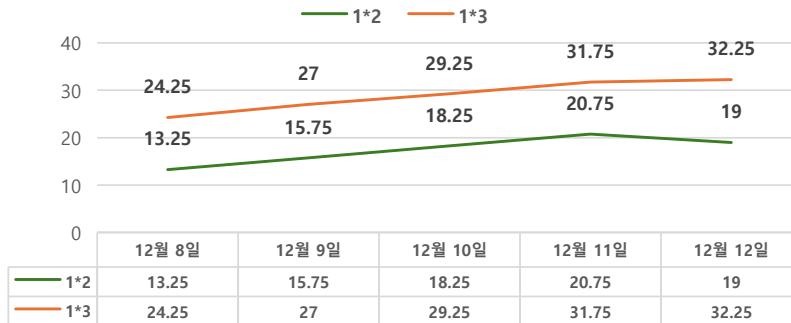
IRS 증가



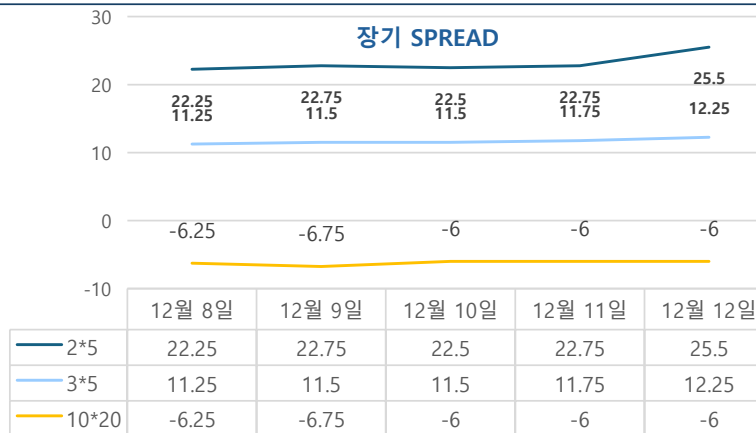
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

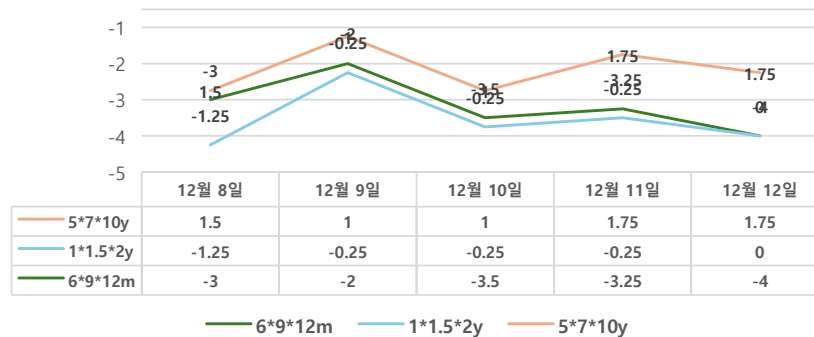


IRS 주요 커브

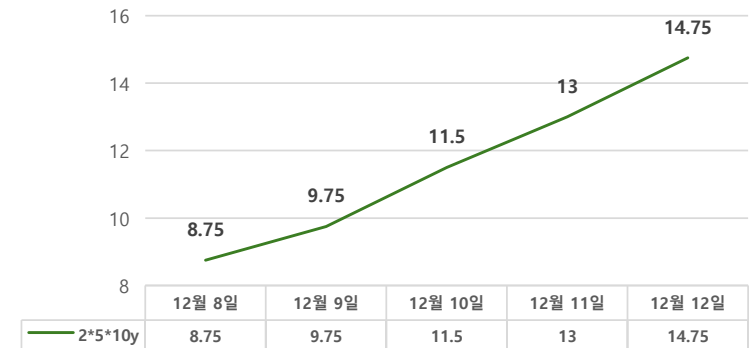
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	19.00	-1.75
1*3y	32.25	0.50
2*5y	25.50	2.75
3*5y	12.25	0.50
5*10y	10.75	1.00
10*20y	-6.00	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-4.00	-0.75
1*1.5*2y	0.00	0.25
2*5*10y	14.75	1.75
5*7*10y	1.75	0.00