

국제금융시장 동향 (일보)

(2024년 1월 11일 목요일)



CPI 앞두고 짙은 관망세...주식 ↑ 채권·달러 혼조

▷ 미국채(USD) 만기별 수익률(%)

| 기간 | 1.10 | 1.9 | 등락(bp) | 월간(bp) | 연초 | 연초비(bp) | 52주 최저 | 52주 최고 | SOFR Swap | Spread(bp) |
|------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|-----------|------------|
| 1y | 4.8152 | 4.8157 | △0.0 | △30.2 | 4.7622 | +5.3 | 3.8270 | 5.5103 | 4.8195 | +0.4 |
| 2y | 4.3580 | 4.3642 | △0.6 | △35.0 | 4.2499 | +10.8 | 3.5531 | 5.2571 | 4.1926 | -16.5 |
| 3 y | 4.1062 | 4.1281 | △2.2 | △35.1 | 4.0088 | +9.7 | 3.3731 | 5.0984 | 3.9001 | -20.6 |
| 5 y | 3.9735 | 3.9699 | +0.4 | △27.3 | 3.8471 | +12.6 | 3.2011 | 4.9920 | 3.6876 | -28.6 |
| 10 y | 4.0283 | 4.0133 | +1.5 | △20.5 | 3.8791 | +14.9 | 3.2477 | 5.0187 | 3.6436 | -38.5 |
| 30 y | 4.2046 | 4.1856 | +1.9 | △12.2 | 4.0282 | +17.6 | 3.4866 | 5.1764 | 3.5108 | -69.4 |

▷ 주요 통화별 단기금리(%)

| 통화 | 3M | | | | 6M | | | |
|---------------|------|------|--------|------|------|------|--------|------|
| | 1.10 | 1.9 | 등락(bp) | 연초 | 1.10 | 1.9 | 등락(bp) | 연초 |
| USD Term SOFR | 5.33 | 5.32 | +1.0 | 5.33 | 5.18 | 5.17 | +1.0 | 5.16 |
| EURIBOR | - | 3.93 | - | 3.91 | - | 3.89 | - | 3.86 |
| JPY Tibor | 0.08 | 0.08 | - | 0.08 | 0.16 | 0.16 | - | 0.16 |

※ [USD SOFR Overnight] 5.31% (1.9) [EUR ESTR Overnight] 3.904% (1.9)

※ [Fed Funds Target Rate] 5.25~5.5% (1.9) [Fed Funds Rate] 5.31% (1.9)

▷ 정부 및 당행 채권 가산금리(bp)

| 발행자(신용등급) | 만기 | 발행시 | 쿠폰금리 | 1.10 | 1.9 | 등락(bp) | 연초 |
|----------------|---------|--------|-------|----------------|----------------|--------|----------------|
| 정부 (Aa2/AA) | '31. 10 | T10+25 | 1.750 | T10+34 (S+70) | T10+34 (S+71) | - | T10+44 (S+75) |
| KEXIM (Aa2/AA) | '27. 01 | T3+53 | 4.625 | T3+51 (S+69) | T3+51 (S+70) | - | T3+53 (S+78) |
| | '29. 01 | T5+63 | 4.500 | T5+57 (S+82) | T5+58 (S+83) | △1.0 | T5+63 (S+89) |
| | '34. 01 | T10+73 | 4.625 | T10+73 (S+107) | T10+73 (S+108) | - | T10+73 (S+107) |

▷ CDS Spread(5년, bp)

| 발행자(신용등급) | 1.10 | 1.9 | 전일비(bp) | 월간(bp) | 연초 | 연초비(bp) | 52주 최저 | 52주 최고 |
|--------------------------|------|-----|---------|--------|-----|---------|--------|--------|
| 대한민국 (Aa2/AA) | 28 | 29 | -1.0 | +0.2 | 27 | +0.7 | 26 | 47 |
| KEXIM (Aa2/AA) | 36 | 36 | - | -1.4 | 36 | -0.1 | 35 | 53 |
| Bahrain (B1/B+) | 215 | 219 | -4.0 | -7.2 | 205 | +9.7 | 204 | 272 |
| CDB* (A1/A+) | 51 | 51 | - | -1.6 | 50 | +0.7 | 50 | 81 |
| KIA Corp (Baa1/BBB+) | 119 | 119 | - | -2.4 | 118 | +1.5 | 117 | 140 |
| PT Pertamina (Baa2/BBB) | 124 | 124 | - | +1.0 | 125 | -0.6 | 107 | 195 |
| POSCO Holdings (Baa1/A-) | 73 | 73 | - | -1.5 | 71 | +2.1 | 70 | 89 |

* China Development Bank

▷ 주요국 환율 및 주가

| 국가 | 1.10 | 전일비 | 연초비 | 종목 | 1.10 | 전일비 | 연초비 | 종목 | 1.10 | 전일비 | 연초비 |
|---------|----------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|-----------|----------|-------|--------|
| USD/KRW | 1,320.25 | +0.3% | +2.3% | Dow | 37,696 | +0.5% | +0.0% | WTI | 71.37 | -1.2% | -0.4% |
| USD/JPY | 145.76 | +0.9% | +3.3% | NIKKEI | 34,442 | +2.0% | +2.9% | Brent | 76.76 | -1.1% | -0.4% |
| GBP/USD | 1.2742 | +0.3% | +0.1% | FTSE | 7,652 | -0.4% | -1.1% | Henry Hub | 3.04 | -4.7% | +20.9% |
| EUR/USD | 1.0973 | +0.4% | -0.6% | STOXX | 4,469 | +0.0% | -1.2% | Corn | 459.50 | +0.1% | -2.5% |
| EUR/KRW | 1,443.65 | +0.3% | +1.0% | KOSPI | 2,542 | -0.8% | -4.3% | Gold | 2,024.41 | -0.3% | -1.9% |
| JPY/KRW | 9.05 | -0.8% | -1.4% | SHCI | 2,878 | -0.5% | -3.3% | Silver | 22.90 | -0.4% | -3.8% |
| USD/CNY | 7.1727 | +0.1% | +1.0% | HSI | 16,097 | -0.6% | -5.6% | Copper | 378.10 | +0.6% | -2.8% |