

국제금융시장 동향 (일보)

(2023년 1월 30일 월요일)



FOMC 앞두고 PCE물가 완화...주식 ↑ 채권 ↓ 달러혼조

▷ 미국채(USD) 만기별 수익률(%)

| 기간 | 1.27 | 1.26 | 등락(bp) | 월간(bp) | 연초 | 연초비(bp) | 52주 최저 | 52주 최고 | SOFR Swap | Spread(bp) |
|-----|--------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|-----------|------------|
| 1y | 4.6438 | 4.6560 | △1.2 | △1.3 | 4.6868 | △4.3 | 0.7032 | 4.8040 | 4.8350 | +19.1 |
| 2y | 4.1990 | 4.1826 | +1.6 | △15.2 | 4.4258 | △22.7 | 1.1296 | 4.7990 | 4.2196 | +2.1 |
| 3y | 3.8971 | 3.8858 | +1.1 | △27.8 | 4.2242 | △32.7 | 1.3336 | 4.7242 | 3.7768 | -12.0 |
| 5y | 3.6102 | 3.5929 | +1.7 | △35.6 | 4.0039 | △39.4 | 1.5212 | 4.5043 | 3.3993 | -21.1 |
| 10y | 3.5035 | 3.4947 | +0.9 | △37.9 | 3.8748 | △37.1 | 1.6662 | 4.3354 | 3.2058 | -29.8 |
| 30y | 3.6190 | 3.6397 | △2.1 | △35.1 | 3.9630 | △34.4 | 2.0595 | 4.4214 | 2.9669 | -65.2 |

※ Libor Swap spread : (2Y) 27.44(-1.77), (3Y) 14.61(-0.85), (5Y) 6.31(0.16), (10Y) -1.85(0.45), (30Y) -37.21(0.43)

▷ 주요 통화별 단기금리(%)

| 통화 | 3M | | | | 6M | | | |
|---------------|------|------|--------|------|------|------|--------|------|
| | 1.27 | 1.26 | 등락(bp) | 연초 | 1.27 | 1.26 | 등락(bp) | 연초 |
| USD Term SOFR | 4.68 | 4.67 | +1.0 | 4.59 | 4.82 | 4.82 | - | 4.78 |
| USD Libor | 4.83 | 4.80 | +3.0 | 4.77 | 5.10 | 5.10 | - | 5.14 |
| EURIBOR | 2.49 | 2.47 | +2.0 | 2.13 | 2.94 | 2.92 | +2.0 | 2.69 |
| JPY Tibor | 0.07 | 0.07 | - | 0.06 | 0.15 | 0.15 | - | 0.14 |

※ [USD SOFR Overnight] 4.3% (1.26) [EUR ESTR Overnight] 1.904% (1.26)

※ [Fed Funds Target Rate] 4.25~4.5% (1.26) [Fed Funds Rate] 4.32% (1.26)

▷ 정부 및 당행 채권 가산금리(bp)

| 발행자(신용등급) | 만기 | 발행시 | 쿠폰금리 | 1.27 | 1.26 | 등락(bp) | 연초 |
|----------------|---------|---------|-------|-----------------|-----------------|--------|-----------------|
| 정부 (Aa2/AA) | '31. 10 | T10+25 | 1.750 | T10+41 (S+69) | T10+41 (S+70) | - | T10+44 (S+75) |
| KEXIM (Aa2/AA) | '26. 01 | T3+85 | 4.875 | T3+77 (S+84) | T3+78 (S+86) | △1.0 | T3+85 (S+101) |
| | '28. 01 | T5+120 | 5.000 | T5+88 (S+107) | T5+89 (S+107) | △1.0 | T5+120 (S+147) |
| | '33. 01 | T10+145 | 5.125 | T10+100 (S+126) | T10+101 (S+127) | △1.0 | T10+145 (S+178) |

▷ CDS Spread(5년, bp)

| 발행자(신용등급) | 1.27 | 1.26 | 전일비(bp) | 월간(bp) | 연초 | 연초비(bp) | 52주 최저 | 52주 최고 |
|--------------------------|------|------|---------|--------|-----|---------|--------|--------|
| 대한민국 (Aa2/AA) | 40 | 41 | -1.0 | -13.3 | 53 | -13.5 | 22 | 75 |
| KEXIM (Aa2/AA) | 46 | 46 | - | -1.9 | 48 | -2.0 | 38 | 68 |
| Bahrain (B1/B+) | 230 | 232 | -2.0 | -20.2 | 257 | -26.7 | 225 | 419 |
| CDB* (A1/A+) | 68 | 68 | - | -10.8 | 79 | -11.4 | 57 | 107 |
| KIA Corp (Baa1/BBB+) | 133 | 133 | - | -12.4 | 145 | -12.5 | 108 | 155 |
| PT Pertamina (Baa2/BBB) | 182 | 182 | - | -15.9 | 198 | -15.9 | 76 | 198 |
| POSCO Holdings (Baa1/A-) | 87 | 87 | - | -11.9 | 99 | -12.2 | 59 | 109 |

* China Development Bank

▷ 주요국 환율 및 추가

| 국가 | 1.27 | 전일비 | 연초비 | 종목 | 1.27 | 전일비 | 연초비 | 종목 | 1.27 | 전일비 | 연초비 |
|----------|----------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|-----------|----------|-------|--------|
| ₩/US\$ | 1,231.30 | +0.0% | -2.3% | Dow | 33,978 | +0.1% | +2.5% | WTI | 79.68 | -1.6% | -0.7% |
| ¥/US\$ | 129.88 | -0.3% | -0.9% | NIKKEI | 27,383 | +0.1% | +4.9% | Brent | 86.66 | -0.9% | +0.9% |
| US\$/£ | 1.2382 | -0.2% | +2.5% | FTSE | 7,765 | +0.1% | +4.2% | Henry Hub | 3.11 | +5.6% | -30.5% |
| US\$/€ | 1.0868 | -0.2% | +1.5% | STOXX | 4,178 | +0.1% | +10.1% | Corn | 683.00 | +0.1% | +0.7% |
| ₩/€ | 1,338.74 | -0.4% | -0.3% | KOSPI | 2,484 | +0.6% | +11.1% | Gold | 1,928.04 | -0.1% | +5.7% |
| ₩/¥ | 9.47 | +0.1% | -1.4% | SHCI | 휴장 | - | - | Silver | 23.60 | -1.3% | -1.5% |
| CNY/US\$ | 휴장 | - | - | HSI | 22,689 | +0.5% | +14.7% | Copper | 422.25 | -1.1% | +10.8% |