

국제금융시장 동향 (일보)

(2023년 10월 4일 수요일)



꺾이지않는 장기 미 국채금리 ...달러 ↑ 추가·채권 혼조

▷ 미국채(USD) 만기별 수익률(%)

기간	9.27	9.26	등락(bp)	월간(bp)	연초	연초비(bp)	52주 최저	52주 최고	SOFR Swap	Spread(bp)
1y	5.4782	5.4513	+2.7	+2.9	4.6868	+79.1	3.7879	5.5001	5.4826	+0.4
2y	5.1354	5.1207	+1.5	+8.7	4.4258	+71.0	3.5531	5.1973	5.0630	-7.2
3 y	4.8964	4.8215	+7.5	+19.9	4.2242	+67.2	3.3731	4.9194	4.7380	-15.8
5 y	4.6848	4.6053	+8.0	+28.4	4.0039	+68.1	3.2011	4.7156	4.4567	-22.8
10 y	4.6075	4.5356	+7.2	+40.6	3.8748	+73.3	3.2477	4.6404	4.3090	-29.9
30 y	4.7190	4.6750	+4.4	+44.2	3.9630	+75.6	3.4028	4.7391	4.0245	-69.5

▷ 주요 통화별 단기금리(%)

통화	3M				6M			
	9.27	9.26	등락(bp)	연초	9.27	9.26	등락(bp)	연초
USD Term SOFR	5.39	5.39	-	4.59	5.47	5.46	+1.0	4.78
EURIBOR	-	3.94	-	2.13	-	4.09	-	2.69
JPY Tibor	0.07	0.07	-	0.06	0.15	0.15	-	0.14

※ [USD SOFR Overnight] 5.31% (9.26) [EUR ESTR Overnight] 3.904% (9.26)

※ [Fed Funds Target Rate] 5.25~5.5% (9.26) [Fed Funds Rate] 5.31% (9.26)

▷ 정부 및 당행 채권 가산금리(bp)

발행자(신용등급)	만기	발행시	쿠폰금리	9.27	9.26	등락(bp)	연초
정부 (Aa2/AA)	'31. 10	T10+25	1.750	T10+34 (S+61)	T10+34 (S+61)	-	T10+44 (S+75)
KEXIM (Aa2/AA)	'25. 09	T2+45	5.375	T2+40 (S+48)	T2+39 (S+47)	+1.0	-
	'28. 09	T5+75	5.125	T5+75 (S+95)	T5+75 (S+94)	-	T5+120 (S+147)
	'33. 09	T10+95	5.125	T10+91 (S+118)	T10+91 (S+118)	-	T10+145 (S+178)

▷ CDS Spread(5년, bp)

발행자(신용등급)	9.27	9.26	전일비(bp)	월간(bp)	연초	연초비(bp)	52주 최저	52주 최고
대한민국 (Aa2/AA)	34	34	-	+0.6	53	-19.5	26	75
KEXIM (Aa2/AA)	39	37	+2.0	-0.0	48	-9.0	35	68
Bahrain (B1/B+)	226	218	+8.0	-0.5	257	-30.7	207	334
CDB* (A1/A+)	63	63	-	-0.5	79	-16.4	58	107
KIA Corp (Baa1/BBB+)	127	129	-2.0	+0.2	145	-18.5	123	155
PT Pertamina (Baa2/BBB)	117	117	-	+0.3	198	-80.9	107	198
POSCO Holdings (Baa1/A-)	77	76	+1.0	-0.5	99	-22.2	72	109

* China Development Bank

▷ 주요국 환율 및 주가

국가	9.27	전일비	연초비	종목	9.27	전일비	연초비	종목	9.27	전일비	연초비
USD/KRW	1,349.40	+0.0%	+7.1%	Dow	33,550	-0.2%	+1.2%	WTI	93.68	+3.6%	+16.7%
USD/JPY	149.63	+0.4%	+14.1%	NIKKEI	32,372	+0.2%	+24.1%	Brent	96.55	+2.8%	+12.4%
GBP/USD	1.2135	-0.2%	+0.4%	FTSE	7,593	-0.4%	+1.9%	Henry Hub	2.76	+4.1%	-38.2%
EUR/USD	1.0503	-0.7%	-1.9%	STOXX	4,132	+0.1%	+8.9%	Corn	483.25	+0.7%	-28.8%
EUR/KRW	1,424.27	-0.2%	+6.1%	KOSPI	2,465	+0.1%	+10.2%	Gold	1,875.12	-1.3%	+2.8%
JPY/KRW	9.06	-0.3%	-5.7%	SHCI	3,107	+0.2%	+0.6%	Silver	22.55	-1.3%	-5.9%
USD/CNY	7.3118	+0.0%	+6.0%	HSI	17,612	+0.8%	-11.0%	Copper	362.70	+0.1%	-4.8%