Eugene's FICC Update

유진투자증권

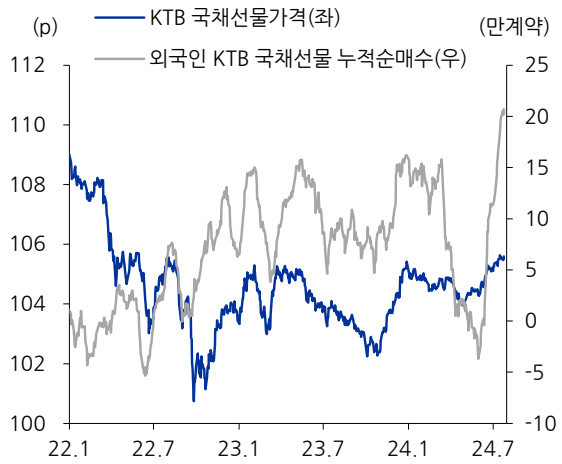
Fixed Income 김지나_ 02)368-6149_ jnkim0526@eugenefn.com Economist 이정훈_ 02)368-6176_ jhoonlee@eugenefn.com RA 유재혁_02)368-6177_dbwogur170@ eugenefn.com

Fixed Income

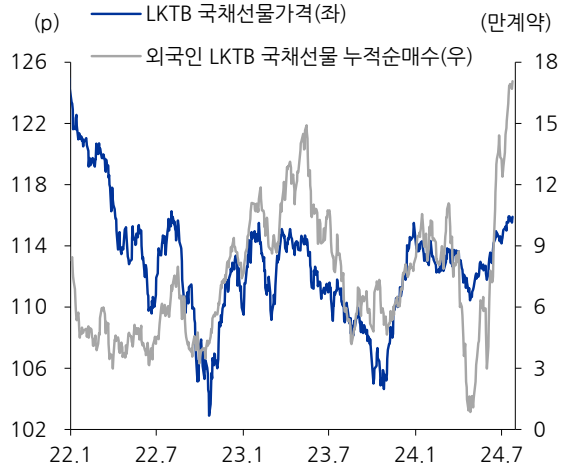
(단위: %,bp, 틱)

		7/24일	1D	1W	YTD
국내 채권	한국 국고채 3년물	3.046%	-3.8	-0.4	-10.8
	한국 국고채 10년물	3.131%	-4.0	-0.8	-5.2
	장단기금리차(10년-3년,bp)	8.5	8.7	8.9	2.9
	3년 국채 선물(KTB)	105.59	12.0	2.0	17
	10년 국채선물(LKTB)	115.90	39.0	5.0	40
해외 채권	미국채 2년물	4.431%	-5.9	-0.8	18.1
	미국채 10년물	4.286%	3.4	12.8	40.7
	장단기금리차(10년-2년,bp)	-14.5	-23.9	-28.1	-37.1
	독일국채 10년물	2.442%	0.3	2.3	43.8
	호주국채 10년물	4.327%	-2.2	7.3	37.3

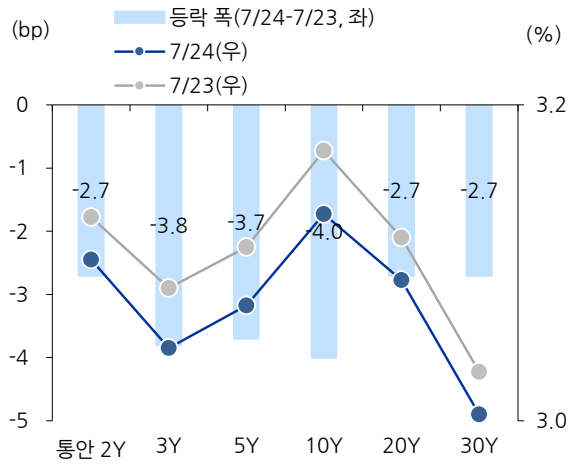
외국인 3년 국채선물(KTB) 수급



외국인 10년 국채선물(LKTB) 수급



일간 금리 등락 폭 & 커브



국내 채권시장 동향

- 국내 채권시장 강세 마감.
- 전일 미 대선 여론조사, 해리스가 트럼프를 소폭 앞섰다는 결과 발표. 이외 미국채 2년물 입찰 호조 반영하며 강세 출발
- 개장 전 발표된 기대인플레, 2년 4개월만에 3%를 하회하여 강세 지지. 외국인은 하루만에 국채선물 순매수로 복귀

전망 및 향후 주요 이벤트

- 미국 채권시장 혼조세 마감.
- 중장기물 가격은 재무부가 바이백을 모두 거절했다는 소식에 하락. 한편 5년물 입찰, 무난히 마무리된 가운데 양호한 수요 확인
- S&P 글로벌 PMI, 제조업은 예상치 밑돌며 위축국면 진입. 다만 서비스업은 호조 보였으며, 종합 PMI는 22년 4월 이후 최고치 경신
- 금일 미국 및 한국 2분기 GDP, 한국 8월 제조업 BSI 등 발표 예정.

자료 출처: 연합인포맥스, Refinitiv, 유진투자증권

본 자료는 참고용 자료일 뿐이고, 특정주식에 대한 투자목적으로 작성된 것이 아닙니다. 본 자료는 담당자가 신뢰할 만하다고 판단하는 자료나 정보에 근거하여 작성되었지만, 그 정확성이나 완전성을 보장할 수는 없습니다. 따라서 본 자료를 참고한 고객의 투자의사 결정은 고객 자신의 판단과 책임아래 이루어져야 하고, 당사는 본 자료의 내용에 의존하여 행하여진 일체의 투자행위의 결과에 대하여 책임을 지지 않을 것임을 밝힙니다. 아울러 본 자료는 당사 고객에게만 제공되는 자료로서 당사의 동의 없이 본 자료를 무단으로 복제/전송/인용/배포하는 행위는 법으로 금지되어 있습니다

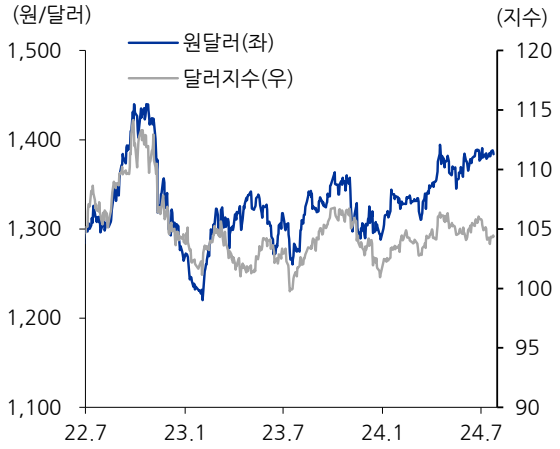
FX & Commodity

(단위: %, $)

		7/24일	1D	1W	YTD
환율	원/달러	1,383.80	-0.2%	0.2%	7.4%
	달러지수	104.36	-0.1%	0.6%	3.0%
	달러/유로	1.084	-0.1%	-0.9%	-1.9%
	위안/달러(역외)	7.27	-0.3%	-0.1%	2.0%
	엔/달러	153.88	-1.1%	-1.5%	9.3%
	달러/파운드	1.291	-0.0%	-0.8%	1.4%
	헤알/달러	5.65	1.2%	3.1%	16.5%
상품	WTI 근월물($)	77.59	0.8%	-6.3%	8.3%
	금 현물($)	2,397.49	-0.5%	-2.5%	16.2%
	구리 3개월물($)	9,050.50	-1.3%	-6.1%	5.7%

원달러 환율 및 위안달러 환율 동향

원달러 환율 및 달러지수 동향



원달러 환율 및 국제유가 동향

원달러 환율 동향

- 원달러 환율은 서울 외환시장에서 -2.40원 하락한 1,383.80원에 마감. 야간거래에서는 1,379.90원으로 낙폭 확대.
- 간밤 달러는 유로화 약세 속에 소폭 강세를 보였고 원달러는 강보합권에서 출발.
- 개장 후 엔달러 환율이 또 한번 급락하면서 원화도 하락 전환. 오후 들어서 엔화가 낙폭을 추가했지만 원화는 1,380원대 중반에서 머물다 장 막판 추가 하락.

달러 지수 동향 및 관전 포인트

- 달러 인덱스는 엔화 급등 영향에 하락.
- 엔화는 전일 아시아 장에 이어 미국 장에서도 또 한번 급등. 다음주 BOJ에서 금리 인상 기대가 높아지면서 그간 숏포지션이 청산. 엔달러는 2주 만에 8엔 가량 하락.
- 미국 S&P 글로벌 PMI는 제조업이 49.5로 위축 국면에 재진입했지만 서비스업이 56.0으로 2년 여 만의 최고치 경신.
- 한편 캐나다는 6월에 이어 2회 연속 금리 인하를 이어가면서 캐나다 달러는 약세. 맥클럼 총재는 경기 하방 압력에 대응하기 위한 것이라 설명.
- 금일 미국 2Q GDP 발표 예정