Eugene's FICC Update

유진투자증권

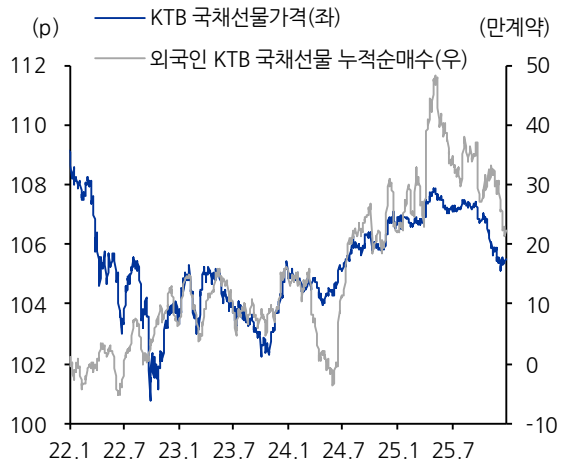
Fixed Income 김지나_ 02)368-6149_ jnkim0526@eugenefn.com Economist 이정훈_ 02)368-6138_ jhoonlee@eugenefn.com

Fixed Income

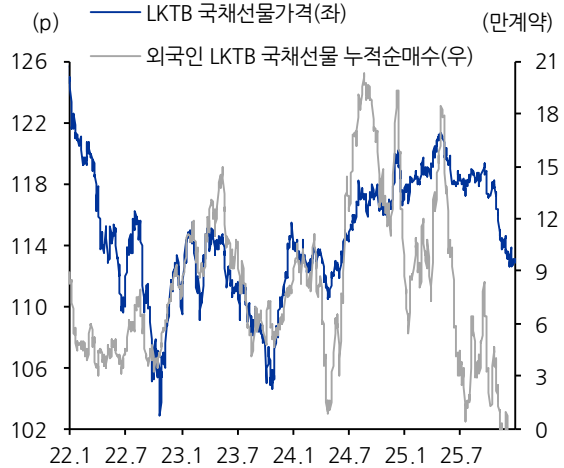
(단위: %,bp, 틱)

		12/29일	1D	1W	YTD
국내 채권	한국 국고채 3년물	2.939%	-1.9	-7.1	34.3
	한국 국고채 10년물	3.354%	-2.0	1.2	49.9
	장단기금리차(10년-3년,bp)	41.5	41.6	33.2	25.9
	3년 국채 선물(KTB)	105.50	9.0	17.0	-115.0
	10년 국채선물(LKTB)	113.08	30.0	43.0	-384.0
해외 채권	미국채 2년물	3.456%	-2.5	-3.0	-78.4
	미국채 10년물	4.112%	-1.7	-3.7	-46.1
	장단기금리차(10년-2년,bp)	65.6	64.9	66.3	33.3
	독일국채 10년물	2.829%	-3.1	-6.7	46.6
	호주국채 10년물	4.755%	1.5	-3.9	38.7

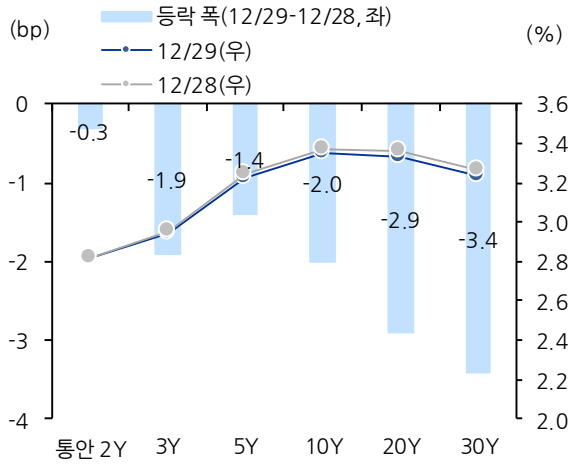
외국인 3년 국채선물(KTB) 수급



외국인 10년 국채선물(LKTB) 수급



일간 금리 등락 폭 & 커브



국내 채권시장 동향

- 국내 채권시장 강세 마감. 환율 안정 영향.
- 개장 초 외국인 국채선물 순매수로 금리 하락 출발. 연말 거래량 축소로 변동성 낮은 모습을 보이는 가운데, 원/달러 환율도 1,430원선을 하회하는 등 추가로 안정되자 금리 하락폭도 확대.
- 기재부, 채권 발행기관 협의체 준비 회의를 개최하며 운영 방향 및 내년 발행계획 등을 논의했고, 필요 시 수시 회의를 통해 시장안정 방안을 논의할 것으로 언급.

전망 및 향후 주요 이벤트

- 미국 채권시장 소폭 강세 마감. 연말로 인한 거래량 축소로 한산한 분위기.
- 개장 초부터 별다른 방향성 없이 좁은 범위 내 등락을 보임. 11월 잠정주택판매가 전월대비 3.3% 급증하며 예상치를 상회했지만 시장에 별다른 영향은 없었음. 오히려 댈러스 연은 제조업 지수가 5개월 연속 위축된 흐름을 보이며 금리 소폭 하락.

자료 출처: 연합인포맥스, Refinitiv, 유진투자증권

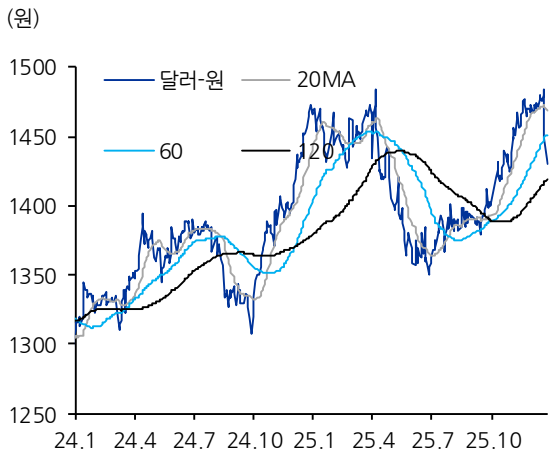
본 자료는 참고용 자료일 뿐이고, 특정주식에 대한 투자목적으로 작성된 것이 아닙니다. 본 자료는 담당자가 신뢰할 만하다고 판단하는 자료나 정보에 근거하여 작성되었지만, 그 정확성이나 완전성을 보장할 수는 없습니다. 따라서 본 자료를 참고한 고객의 투자의사 결정은 고객 자신의 판단과 책임아래 이루어져야 하고, 당사는 본 자료의 내용에 의존하여 행하여진 일체의 투자행위의 결과에 대하여 책임을 지지 않을 것임을 밝힙니다. 아울러 본 자료는 당사 고객에게만 제공되는 자료로서 당사의 동의 없이 본 자료를 무단으로 복제/전송/인용/배포하는 행위는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

FX & Commodity

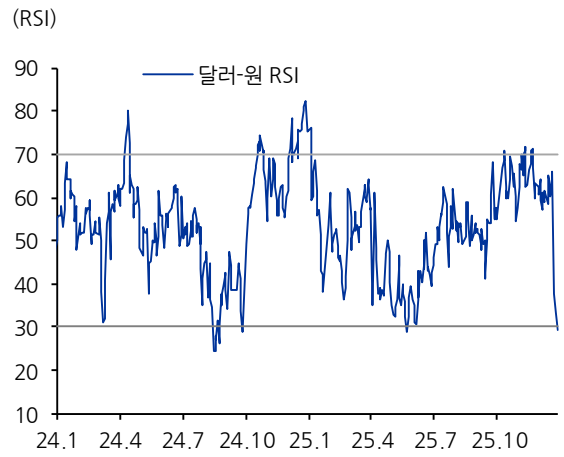
(단위: %, $)

		12/29일	1D	1W	YTD
환율	원/달러	1,429.80	-0.7%	-3.1%	-2.9%
	달러지수	98.03	0.0%	-0.3%	-9.6%
	달러/유로	1.177	0.0%	0.1%	13.7%
	위안/달러(역외)	7.00	-0.1%	-0.5%	-4.6%
	엔/달러	156.07	-0.3%	-0.6%	-0.7%
	달러/파운드	1.350	0.0%	0.3%	7.9%
	헤알/달러	5.57	0.5%	-0.3%	-9.9%
상품	WTI 근월물($)	57.81	1.9%	2.0%	-19.4%
	금 현물($)	4,334.51	-4.3%	-2.4%	65.2%
	비트코인($)	87,700.00	0.9%	-0.4%	-6.8%

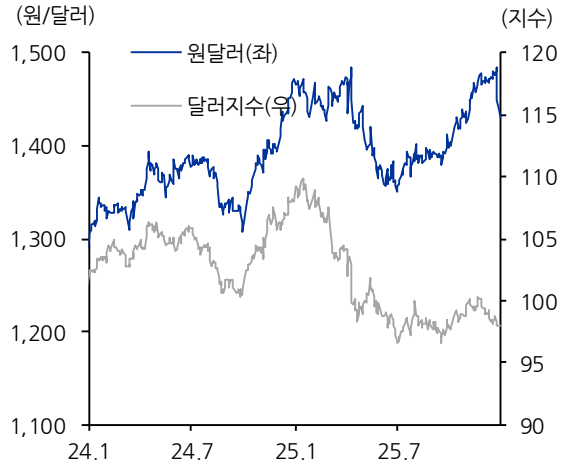
달러-원 환율 및 이동평균선



달러-원 환율 상대강도지수



달러-원 환율 및 달러인덱스 동향



원달러 환율 동향

- 달러-원은 서울 외환시장에서 -10.50원 하락한 1,429.80원에 마감. 야간거래에서는 1,434.10원 마감.
- 이날도 보합권에서 출발한 달러-원은 장 초반을 고점으로 매도 물량이 출회되면서 하락하는 흐름을 반복. 당국 추정물량과 함께 환율 하락에 따른 네고 물량도 함께 출회되면서 결제 수요를 앞질렀음.
- 이날 코스피는 +2.2% 급등해 사상 최고치에 근접했고, 외국인들은 국내 주식을 4,000억원 가량 순매수.

달러 지수 동향 및 관전 포인트

- 달러 인덱스는 이벤트 부재 속 강보합권.
- 전일 일본 12월 BOJ 의사록에서 대체로 점진적인 추가 금리 인상을 지지하자 엔화가 소폭 강세를 보였으나 달러는 크게 움직이지 않았음.
- 역외 위안화(CNH) 환율은 외환당국의 구두 개입에 잠깐 반등했으나, 재차 하락하며 달러 당 7위안을 하회 중.
- 전일 급락했던 국제유가는 러시아가 우크라이나 드론이 푸틴의 관저를 공격했다고 주장하자 반등. 트럼프는 지난주 베네수엘라의 부두 시설을 타격했다고 언급.