Eugene's FICC Update

유진투자증권

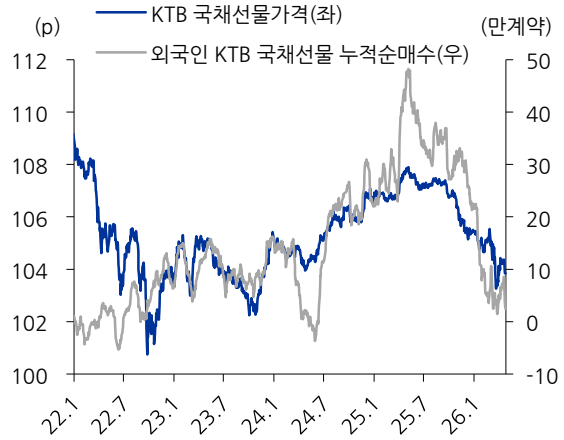
Fixed Income 김지나_ 02)368-6149_ jnkim0526@eugenefn.com RA 이준영_ 02)368-6136_ lee.jy@eugenefn.com

Fixed Income

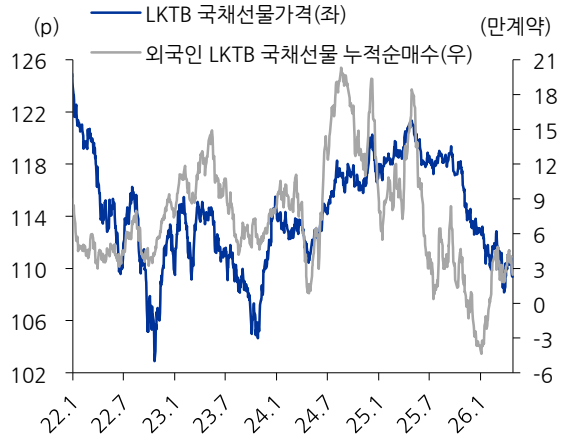
(단위: %,bp, 틱)

		4/27일	1D	1W	YTD
국내 채권	한국 국고채 3년물	3.492%	-0.4	14.4	53.9
	한국 국고채 10년물	3.820%	0.3	13.2	43.5
	장단기금리차(10년-3년,bp)	32.8	32.1	34.0	43.2
	3년 국채 선물(KTB)	103.84	0.0	-48.0	-160.0
	10년 국채선물(LKTB)	109.36	-4.0	-124.0	-356.0
해외 채권	미국채 2년물	3.799%	1.9	7.6	32.7
	미국채 10년물	4.341%	3.9	9.0	17.3
	장단기금리차(10년-2년,bp)	54.2	52.2	52.8	69.6
	독일국채 10년물	3.036%	4.3	5.6	18.1
	호주국채 10년물	4.978%	0.0	4.2	22.5

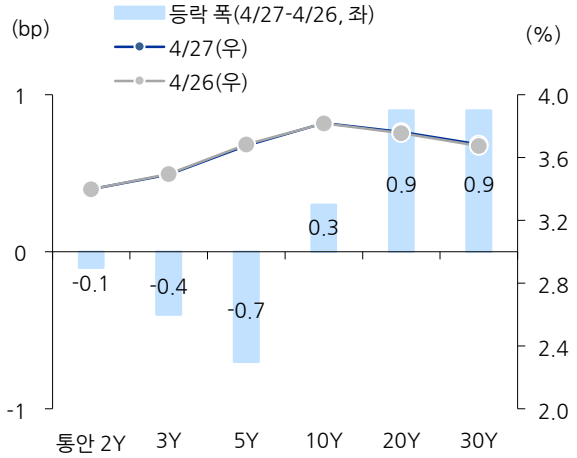
외국인 3년 국채선물(KTB) 수급



외국인 10년 국채선물(LKTB) 수급



일간 금리 등락 폭 & 커브



국내 채권시장 동향

- 국내 채권시장 혼조 마감.
- 최근 1분기 GDP 호조 이후 금리 급등에 따른 되돌림 매수세가 나타나면서 오전 금리 하락 출발.
- 이후 별다른 재료가 없었던 가운데 미-이란 협상의 진전도 없어 금리 보합권으로 회귀하며 등락을 지속하다 마감.

전망 및 향후 주요 이벤트

- 미국 채권시장 약세 마감.
- 미-이란 협상이 지지부진한 가운데, 불안감 겹치며 국제유가 급등한 영향.
- 물가 우려에 BEI도 상승했고, 미국채 2년과 5년 입찰도 부진해 금리 상승. 21개 기업의 회사채 발행도 이어지며 물량 부담 컸음. FOMC 앞둔 경계심은 크지 않았음.

자료 출처: 연합인포맥스, Refinitiv, 유진투자증권

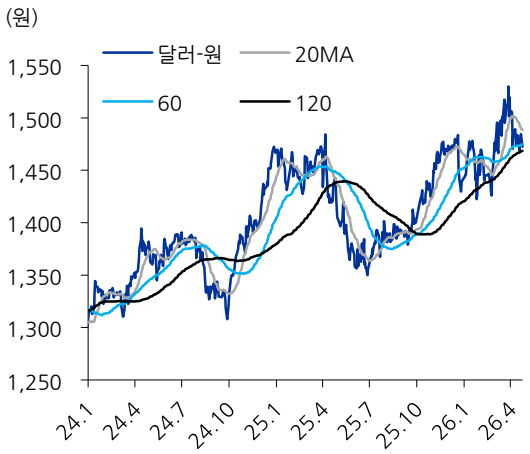
본 자료는 참고용 자료일 뿐이고, 특정주식에 대한 투자목적으로 작성된 것이 아닙니다. 본 자료는 담당자가 신뢰할 만하다고 판단하는 자료나 정보에 근거하여 작성되었지만, 그 정확성이나 완전성을 보장할 수는 없습니다. 따라서 본 자료를 참고한 고객의 투자의사 결정은 고객 자신의 판단과 책임아래 이루어져야 하고, 당사는 본 자료의 내용에 의존하여 행하여진 일체의 투자행위의 결과에 대하여 책임을 지지 않을 것임을 밝힙니다. 아울러 본 자료는 당사 고객에게만 제공되는 자료로서 당사의 동의 없이 본 자료를 무단으로 복제/전송/인용/배포하는 행위는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

FX & Commodity

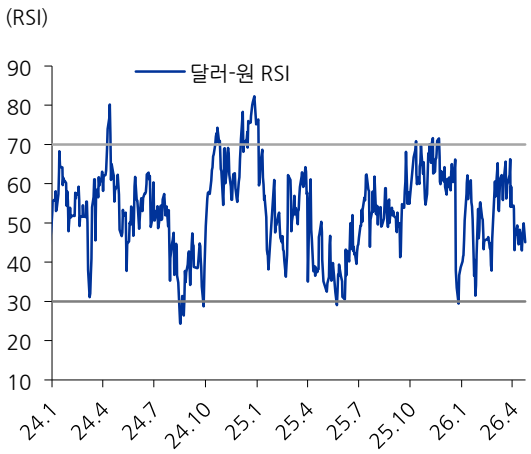
(단위: %, $)

		4/27일	1D	1W	YTD
환율	원/달러	1,472.50	-0.8%	-0.3%	2.3%
	달러지수	98.48	0.0%	0.4%	0.2%
	달러/유로	1.172	0.0%	-0.6%	-0.2%
	위안/달러(역외)	6.83	-0.1%	0.1%	-2.3%
	엔/달러	159.42	0.0%	0.4%	1.8%
	달러/파운드	1.354	0.0%	0.0%	0.5%
	헤알/달러	4.98	0.1%	0.3%	-9.7%
상품	WTI 근월물($)	96.37	2.1%	7.5%	67.8%
	금 현물($)	4,682.49	-0.6%	-2.9%	8.4%
	비트코인($)	77,190.00	-1.0%	1.1%	-12.2%

달러-원 환율 및 이동평균선



달러-원 환율 상대강도지수



달러-원 환율 및 달러인덱스 동향

원달러 환율 동향

- 달러-원은 서울 외환시장에서 전일 대비 -12.00원 하락한 1,472.50원에 마감(야간 1,473.60원)
- 이란이 미국 측에 해상 통제 완화와 종전 선언을 선행한 뒤 핵 협상을 이어가자는 절충안을 전달했다는 보도가 전해짐. 호르무즈 해협 재개방 가능성에 달러-원은 1,480원선에서 1,470원대로 하락.
- 코스피는 6,600선을 돌파하며 사상 최고치를 재차 경신, 외국인도 4거래일 만에 유가증권시장에서 8,675억원 순매수로 전환. 주식시장으로의 자금 유입도 환율 하락 요인으로 작용.
- 한편 한국의 3월 실질실효환율(REER)은 85.44로 2009년 이후 최저치까지 하락. 이란 전쟁으로 인한 고유가 부담이 원화 약세 요인으로 작용한 것으로 판단.

달러 지수 동향 및 관전 포인트

- 달러인덱스는 전일에 이어 소폭 하락(DXY -0.02%)
- 4/9일 이후 12거래일째 98선 박스권에서 움직이는 모습. 이란이 해상 봉쇄 완화 후 핵 문제를 후속 협상으로 넘기자는 절충안을 제시했다는 소식이 전해지며 달러인덱스는 약보합 마감.
- 반면 이스라엘과 헤즈볼라 간 무력 충돌로 국제유가는 +2%대 상승(WTI 선물가 +2.1%, 브렌트 선물가 +2.8%). 브렌트는 배럴당 110달러에 근접.
- 금일 BOJ 금융정책결정회의 예정