

1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가격, 전일 美 대선 TV토론에서 힐러리 클린턴 민주당 후보가 우위를 보였다는 분위기 속에 5년물 입찰을 앞둔 부담에도 불구하고 WTO의 올해 세계 교역량 증가율 하향 & 도이체뱅크에 대한 우려 확산으로 안전자산 선호가 커져 상승

- WTO, 올해 세계 교역량 증가율을 지난 2.8%보다 1.1% 포인트 낮은 1.7%로 수정...지난해 말 나온 전망치 3.9%의 절반도 안 되는 수준

- 메르켈 독일 총리, 도이체뱅크 정부 지원 가능성과 관련해 즉답을 피하며 호전되리라 기대한다는 원론 피력

- 미국 재무부, 이날 \$340억 어치 5년만기 국채를 연 1.129%에 발행...입찰 수요 강도를 나타내는 응찰률은 2.39배

중앙은행 등 간접입찰자들의 낙찰률은 61.4%로 지난 4차례 평균인 61.5%와 거의 같았다

[미국]

2y 0.72% (-0.2bp)

10y 1.56% (-2.8bp)

30y 2.28% (-4.3bp)

[기타 10Y물]

영국 0.67% (-2.5bp)

독일 -0.14% (-2.4bp)

프랑스 0.16% (-1.6bp)

이탈리아 1.21% (+2.4bp)

스페인 0.89% (-1.9bp)

그리스 8.19% (-4.2bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 美 대선 토론회 클린턴 우세 평가 & 지표 호조에 상승

* 이날 상승 출발한 지수는, 대선 토론회서 클린턴 후보가 우세했다는 주요 언론의 보도가 나오면서 안도감에 상승 폭 확대

* 美 소비자신뢰도가 개선되는 등 경제지표 대체로 긍정적인 결과

- 9월 소비자신뢰지수 101.8-> 104.1 (예상:98.3)...2007년 8월이후 최고치

- 9월 서비스 PMI 51.0-> 51.9 (예상:51.1)

- 7월 20대 대도시주택가격(YoY) 4.98%→ 5.07% (예상:5.1%)

* <유럽 마감> 유가 하락 & 금융 부진에 하락 마감

오름세로 출발했지만 국제 유가가 2% 가까이 하락하면서 에너지 업종이 부진했고 도이체방크가 또 다시 사상 최저치로 추락하면서 금융 업종도 일제히 하락했다.

* <상하이 마감> 거래량이 감소하는 등 전반적인 투자 심리의 부진을 나타냈지만 금융·부동산 등 일부 업종의 주도로 상승

* <도쿄 마감> 힐러리 클린턴 미국 민주당 대선 후보가 도널드 트럼프 공화당 후보와 진행한 TV 토론에서 우위를 점했다는 평가 속에 강세 흐름

DOW30	18228.30	(+0.74%)
NASDAQ	5305.71	(+0.92%)
S&P500	2159.93	(+0.64%)
NIKKEI225	16683.93	(+0.84%)
SHANGHAI	2998.17	(+0.60%)
FTSE100	6807.67	(-0.15%)
DAX30	10361.48	(-0.31%)
CAC40	4398.68	(-0.21%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 도이체방크발 불안에 따른 안전자산 선호로 유로화에 올랐고, 힐러리 클린턴 민주당 후보 지지율 우위로 멕시코 페소화 등 신흥국 통화에 대해서는 내리며 혼조세

유로/달러	1.1214	(-0.0039)
유로/엔	112.64	(-0.27)
달러/엔	100.41	(+0.10)
달러/위안	6.6646	(-0.0098)
파운드/달러	1.30214	(+0.00465)
NDF	1097.00 / 1097.50원...0.35원 상승	

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 산유량 동결 난망 & 골드만삭스 유가 전망 하향에 하락

- 골드만 삭스, 공급 과잉이 지속될 것이란 점을 이유로 올 4분기 WTI 전망 기존의 \$50에서 \$43로 하향

- 주요 산유국들이 알제리 회동에서 산유량 동결 합의를 끌어내기 어려울 것이라는 전망이 유가에 부정적인 영향

* <국제 금값> 미 첫 대선 후보 TV 토론회에서 힐러리가 우위를 보였다는 분석과 달러화 강세, 긍정적 경제지표 등에 따른 안전자산 매수세 약화로 하락

WTI 44.67 (-2.7%)

COMEX금 1330.40 (-1.0%)

5. 전일 국내 지표

코스피 2062.82 (+0.77%)

코스닥 687.99 (+0.18%)

원/달러 1096.50 (-11.40)

KTB 110.79 (-0.01)

LKTB 132.34 (-0.01)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리, 구간별로 차별화. 단기물과 5년 구간은 약세를 보인 반면 10년 이상 장기물은 강세 흐름 이어져.

- 美 대선후보 TV 토론회에서 힐러리 후보가 트럼프 후보를 앞질렀다는 결과가 나오면서 증시가 반등해 채권시장에 부담 요인으로 작용

- 익일 국고채 50년물 입찰 부담 & 장내 채권시장 마감 후 발표될 9월 금통위의사록 대기 심리도 강해

1y 1.3250% (+0.40bp)

3y 1.3050% (-0.30bp)

5y 1.3420% (+0.20bp)

10y 1.4940% (-0.10bp)

20y 1.5040% (-1.30bp)

30y 1.5100% (-1.30bp)

CD 1.3400% (0.00bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1Y	-5.30bp	(-0.25bp)
2Y	-7.55bp	(+0.10bp)
3Y	-4.75bp	(+0.80bp)
5Y	-5.95bp	(+0.55bp)
10Y	-14.90bp	(+1.10bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 소폭 상승 마감. 오전에는 美 대통령 선거 TV토론 영향으로 거래가 많이 없는 분위기. 오후에는 중기물 위주로 거래가 다소 있는 듯 했으나 금리 변동 폭은 크지 않았음.

* CRS도 소폭 상승 마감. 큰 폭의 변동없이 조용한 분위기.

*IRS 금리

1Y	1.2800%	(+0.25bp)
2Y	1.2625%	(+0.50bp)
3Y	1.2575%	(+0.50bp)
5Y	1.2825%	(+0.75bp)
7Y	1.3000%	(+0.75bp)
10Y	1.3450%	(+1.00bp)

1*2Y	-1.75	(+0.25bp)
2*3Y	-0.50	(+0.00bp)
2*5Y	2.00	(+0.25bp)
3*5Y	2.50	(+0.25bp)
5*7Y	1.75	(0.00bp)
5*10Y	6.25	(+0.25bp)

*CRS 금리

1Y	1.2050%	(+0.50bp)
----	---------	-----------

2Y	1.0500%	(+0.50bp)
3Y	1.0250%	(+0.50bp)
5Y	0.9600%	(+0.50bp)
7Y	0.9050%	(+0.50bp)
10Y	0.8750%	(+0.50bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* BOJ 7월 의사록, ETF 매입 확대...일부 우려 목소리도

- 아홉 명 위원 중 일곱 명이 추가 완화 결정에 찬성...반대 의사를 표명한 위원들은 ETF 매입 확대 규모가 과도하게 크다면서 훗날 정책을 마무리하기 더 어려워질 것이라 평가
- 정책 결정에 찬성한 다른 위원은 ETF 매입 확대로 BOJ의 재무 건전성이 영향을 받을 수 있다고 지적
- 위원 다수는 인플레이션 기대 심리가 약화되고 있다고 지적했고 일부는 인플레이션 기대 심리가 빠른 시일 내에 강화되지는 못할 것이라고 경고

* BOJ 부총재 '실효금리를 낮추기 위한 조치를 취했으나, 일본의 잠재 경제성장률을 끌어올리려면 구조개혁 역시 필요하다'

* 힐러리 우세에 멕시코 페소화 가치 상승

美 경제 의존도가 높은 멕시코에 대해 이민자와 국경 통제 정책을 강력하게 쓰겠다는 의지를 피력해온 트럼프 지지율 하락으로 페소화는 달러당 19.44페소까지 하락하며 140개국 통화 중 가장 강세를 보임

* BOE, 역경매 방식을 통해 이번주 총 3회에 걸쳐 회사채 매입 나설 계획 <FT>

* IMF '글로벌 무역증가 둔화 & 저성장 고착화... 보호주의 타파해야한다'

[국내]

* 금통위원 "물가목표 도달 시점 지연될 가능성 커"

- "7월 성장전망경로 벗어나지 않았지만 하방리스크 점검해야"
 - "가계부채 대책 효과, 부동산시장 동향 모니터링"
 - "저금리 기조가 금융회사 수익성에 미치는 영향 모니터링"
 - "건설부문 활황 유례없이 높은 수준"
-

- _ "중기물가 도달 시점 지연 위험 높아진 것은 사실"
- _ "기업구조조정에 고용시장 개선 흐름 악화 가능성"

****금일 예정 지표****

[재닛 옐런 연준 의장 미 하원 증언]

[닐 카시카리 미니애폴리스 연은 총재 연설]

[제임스 블라드 세인트루이스 연은 총재 연설]

[찰스 에번스 시카고 연은 총재 연설]

[ECB 드라기 총재 연설]

독일-8월 GfK 소비자신뢰지수 (예상:10.2, 이전:10.2)

미국-8월 내구재수주(MoM) (예상:-1.5%, 이전:4.4%)

-8월 근원내구재수주(MoM) (예상:-0.4%, 이전:1.3%)

-원유재고 (이전:-6.200M)

한국-9월 소비자신뢰지수 (이전:102)