1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가격, 제조업 지표 약화에다 강성 매파인 스탠리 피셔 연준 부의장이 연내 금리 인상 의지를 보이지 않음에 따라 최근의 하락세를 접고 상승

* 美 엠파이어스테이트지수 위축세 지속, 시장 예상에 못 미친 산업생산 등으로 저가매수세가 강해진 것도 국채가 반등에 한 몫
* 국채가, 오후 들어 피셔 부의장이 연설에서 기준금리 인상 시기에 관해 명시하지 않고 저금리의 폐해에 대해서 언급하는 선에 그치면서 최근 높아진 연내 기준금리 인상 가능성이 더 커질 수 없다는 기대로 오름폭을 확대
* 지난주 옐런 의장의 '인플레이션 오버슈팅' 용인 시사 발언 & BOE 카니 총재가 '英 실업률 가파르게 상승하는 것을 막기 위해서 물가가 목표치를 소폭 웃도는 것을 감내할 준비가 됐다'고 밝힌 여파로 美 10년만기 국채수익률은 장중 한때 1.814% 까지 오르며 지난 6월2일 이후 최고치 기록

[미국]
2y 0.81% (-2.0bp)
5y 1.25% (-3.3bp)
10y 1.77% (-3.2bp)
30y 2.52% (-3.7bp)

[기타 10Y물]
영국 1.12% (+2.7bp)
독일 0.05% (-0.2bp)
프랑스 0.33% (+0.3bp)
이탈리아 1.40% (+1.9bp)
스페인 1.11% (-1.2bp)
그리스 8.28% (+6.6bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 피셔 부의장 발언과 유가 약세에 하락 마감

* 피셔 연준 부의장, '저금리 부작용' 경고... 기준금리 인상 시기 언급 없어
  - '초저금리가 장기 경제 성장에 대한 암울한 신호이며 美 경제를 외부 충격에 취약하게 할 수 있다'는 기존의 견해를 반복
  - '경기 부양적인 재정정책은 앞으로 장기 재정 건전성을 훼손하지 않는다면 경제에 긍정적인 영향을 미칠 수 있다'

* 국제유가, 이란 '감산 없을 것' 발언에 일제 하락... WTI $50 붕괴
  - 이란 석유장관, OPEC이 다음 달 회의에서 생산량 제한에 합의하길 바란다면서도 현재 이란이 원유 및 천연가스, 석유화학품 분야에 $2000억 규모의 투자를 추진 중 밝혀

- 국영이란국유공사 사장, '현재 일일 389만배럴인 석유 생산량을 확대할 방침'
- OPEC 회원국들, 지난 9월 하루 3천360만배럴의 원유를 생산...몇몇 회원국들 계속 생산량을 늘릴 것이라는 의지를 나타냄
- 美 오일채굴장치, 4개 증가한 432개 기록... 16주 연속 증가세

* 美 제조업이 달러화 강세와 세계 수요 부진에 아직 시달리고 있음을 보여준 美 경제지표 결과
- 9월 산업생산 전월대비 +0.1%...조사치 +0.2% 하회
- 10월 뉴욕 엠파이어스테이트 제조업지수 전월 -2.0 에서 -6.8로 하락...지난 5월이후 최저 수준

* <유럽 마감> 오는 20일 열리는 ECB 통화정책 회의를 앞두고 관망론이 확산되면서 약세 마감

* <상하이 마감> 3분기 GDP 발표를 비롯한 각종 경제지표 발표를 앞둔 관망세 속에서 외국인 전용 주식인 상하이B주가 오후 들어 6% 이상 폭락하자 장 막판 하락 마감

* <도쿄 마감> 뉴욕 증시의 상승으로 투자 심리 유지 & 엔화 약세로 상승

DOW30	18086.40	(-0.29%)
NASDAQ	5199.82	(-0.27%)
S&P500	2126.50	(-0.30%)
NIKKEI225	16900.12	(+0.26%)
SHANGHAI	3041.17	(-0.74%)
FTSE100	6947.55	(-0.94%)
DAX30	10503.57	(-0.73%)
CAC40	4450.23	(-0.46%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 매파 성향의 연준 부의장 연설에서 금리 인상 시기에 관한 언급을 하지 않는 것이 12월 금리 인상 기대를 약화해 하락

유로/달러	1.0999	(+0.0028)
유로/엔	114.26	(-0.42)
달러/엔	103.88	(-0.26)
달러/위안	6.7379	(+0.0222)
파운드/달러	1.21820	(+0.00006)
NDF	1136.50 / 1137.50원...1.25원 하락	

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 이란 '감산 없을 것' 발언 & 공급과잉 우려감에 하락
* <국제 금값> 단기 급락에 따른 저가 매수세 유입과 달러화 강세분위기 주춤에도 연내 금리인상 가능성 상존 등으로 오름폭 제한

WTI 49.94 (-0.8%)...지난 7일이후 처음으로 $50하회
COMEX금 1256.60 (+0.1%)

5. 전일 국내 지표

코스피 2027.61 (+0.24%)
코스닥 659.83 (-0.77%)
원/달러 1137.90 (+5.80)
KTB 110.56 (-0.15)
LKTB 130.80 (-0.85)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리, 장기물 금리가 상대적으로 더 올라 베어 스티프닝.
- 지난주 美 9월 생산자물가지수(PPI) 반등으로 장기채를 중심으로 금리가 상승한 영향에 10선은 장초반부터 반빅 가량 하락 출발.
- 국고 10년물 입찰은 시장 약세 분위기에 부진한 결과.
- 외인이 10선 매수에 나서며 오후들어 시장이 반등하는 모습을 보였지만, 국내 기관들의 매수심리가 훼손되면서 장 막판 국채선물 가격은 장기물 위주로 급락

1y 1.3630% (+1.60bp)
3y 1.3500% (+3.10bp)
5y 1.4190% (+5.50bp)
10y 1.6150% (+6.50bp)
20y 1.6580% (+6.80bp)
30y 1.6670% (+6.80bp)
50y 1.6550% (+7.30bp)
CD 1.3400% (0.00bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1Y -5.60bp (-0.45bp)

2Y -6.05bp (-0.80bp)
3Y -2.00bp (+0.65bp)
5Y -3.65bp (-0.50bp)
10Y -12.25bp (+0.50bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 장기물을 중심으로 큰 폭 상승. 글로벌 커브가 스팁된 영향
* CRS, 장중에 오퍼가 유입되기도 했지만 금리 상승을 반영하면서 전 구간에 걸쳐 상승

*IRS 금리

1Y 1.3150% (+1.25bp)
2Y 1.3075% (+2.50bp)
3Y 1.3300% (+3.75bp)
5Y 1.3825% (+5.00bp)
7Y 1.4175% (+5.75bp)
10Y 1.4925% (+7.00bp)

1*2Y -0.75 (+1.25bp)
2*3Y 2.25 (+1.25bp)
2*5Y 7.50 (+2.50bp)
3*5Y 5.25 (+1.25bp)
5*7Y 3.50 (+0.75bp)
5*10Y 11.00 (+2.00bp)

*CRS 금리

1Y 1.1700% (+0.50bp)
2Y 1.0200% (+0.50bp)
3Y 0.9650% (+1.00bp)
5Y 0.9150% (+1.00bp)
7Y 0.8650% (+2.50bp)
10Y 0.8450% (+2.50bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* BOJ 구로다, '물가목표 달성 위해 필요시 정책 조정'
  - '근원 CPI 상승률이 목표치인 2%로 상승하기 전에 당분간 마이너스 영역에 머물거나 제로 수준을 기록할 것'
  - 물가 목표 달성의 동력을 유지하기 위해 필요에 따라 정책을 조정할 것이라고 강조

* 中 인민은행, 17일 달러-위안 기준환율 전장대비 0.0222위안 올린 6.7379위안에 고시 (0.33% 절하)
  - 지난 14일 인민은행은 위안화 가치를 0.21% 절상시켜 위안화 약세 압력에 제동을 걸었으나 이내 다시 절하 기조로 돌아섬
  - 2010년 9월 13일(6.7509위안) 이후 최저치를 경신한 것으로 10월 위안화 절하율은 현재까지 0.89%에 달함

* 에릭 로젠그렌 미국 보스턴 연은 총재, 수익률 곡선의 기울기를 가파르게 하는 (커브 스티프닝) 대안적인 긴축 방법을 제안 <WSJ>
  - '연준의 대차대조표상에서 장기 유가증권을 단기 유가증권을 대체함으로써 장기금리를 올리자' 제안
  - 장기금리가 현재 낮은 이유 중 하나는 연준이 상당히 듀레이션이 긴 대규모의 대차대조표를 갖고 있기 때문이라 설명

[국내]

* 한은 "거시경제 불확실성 높아...내수 위축 우려"

금일 예정 지표

[필립 로우 호주중앙은행 총재 연설 & 10월 회의 의사록]

미국-9월 근원 CPI(MoM) (예상:0.2%, 이전:0.3%)
  -9월 CPI(MoM) (예상:0.3%, 이전:0.2%)
  -9월 근원 CPI(YoY) (예상:2.3%, 이전:2.3%)
  -10월 NAHB 주택시장지수 (예상:63, 이전:65)
영국-9월 CPI(YoY) (예상:0.9%, 이전:0.6%)
  -9월 CPI(MoM) (예상:0.1%, 이전:0.3%)