

1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가격, 연내 기준금리 인상 기대로 단기물은 내렸지만 비둘기 ECB기대로 장기물은 오르는 등 수익률곡선의 평탄화가 진행되면서 혼조

* 국채가격, 연준위원들 연설을 앞둔 가운데 전일 마리오 드라기 ECB 총재 발언에 따른 통화완화 지속 기대로 10년물 위주의 상승세 이틀째 지속... 다만 미국의 물가 상승 압력 우려가 계속되어 상승 제한

* 국채가는 오후 들어 오름폭을 줄였다가 다시 벌리는 등 주말을 앞두고 오락가락

[미국]

2y 0.82% (+0.4bp)

5y 1.24% (-1.0bp)

10y 1.73% (-2.1bp)

30y 2.48% (-1.9bp)

[기타 10Y물]

영국 1.09% (+1.1bp)

독일 0.00% (+0.3bp)

프랑스 0.28% (+0.4bp)

이탈리아 1.37% (+0.6bp)

스페인 1.11% (+1.1bp)

그리스 8.28% (-0.2bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 기업들의 엇갈린 실적과 달러 강세 등의 영향이 복합적으로 작용하며 혼조세

* 제너럴일렉트릭(GE), 시장 전망치를 웃도는 3분기 조정 주당순이익 발표에도 불구하고 예상 못미친 매출 & 연간 실적 전망치도 하향 조정에 주가 0.31% 하락

반면 마이크로소프트(MS)와 맥도날드는 실적 호조에 힘입어 4.3%와 3% 상승하며 버팀목 역할

* 대형 M&A 소식에 주가 희비

- 통신칩 제조업체 퀄컴, 네덜란드 NXP반도체 인수 추진... 최종 협상이 성사되면 이는 반도체업계 사상 최대 M&A로 기록될 전망

- 미국 통신업체 AT&T, 미디어 업체 타임워너 인수 추진

* 달러, 연내 기준금리 인상 가능성이 높아지면서 8개월 만에 최고치 기록

- 달러 인덱스, 전날보다 0.45% 상승한 98.77을 기록... 지난 2월 이후 가장 높은 수준

* <유럽 마감> 엇갈린 기업 실적과 7개월 최저치로 떨어진 유로화 영향으로 혼조세
 - 에릭슨, 3Q 부진한 실적을 공개하면서 5.9% 하락한 반면 자동차 부품업체 발레오는 연간 실적 전망을 8% 상향 조정하면서 3% 상승

* <상하이 마감> 위안화 약세 속 종일 보합권에서 등락을 거듭하다 소폭 상승세로 마감

* <도쿄 마감> 환율 상승으로 오전 거래에서 상승세를 보이던 일본증시, 일본 뎡토리현의 지진 소식에 하락 반전

DOW30	18145.71	(-0.09%)
NASDAQ	5257.40	(+0.30%)
S&P500	2141.16	(-0.01%)
NIKKEI225	17184.59	(-0.30%)
SHANGHAI	3090.94	(+0.21%)
FTSE100	7020.47	(-0.09%)
DAX30	10710.73	(+0.09%)
CAC40	4536.07	(-0.09%)

3.글로벌 환시

* 유로화, ECB의 통화완화정책 지속 확인에다 연준의 연내 금리 인상 기대가 높아져 하락
 - ECB 통화완화 지속 기대로 유로화는 1.0858달러까지 내려 지난 3월 이후 최저치 기록

유로/달러	1.0883	(-0.0046)
유로/엔	113.02	(-0.59)
달러/엔	103.78	(-0.16)
달러/위안	6.7558	(+0.0247)
파운드/달러	1.22280	(-0.00232)
NDF	1135.70 / 1136.70원...1.00원 상승	

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 미국 원유채굴장비수 증가에도 산유국들의 시장 안정 노력에 대한 기대로 강세
 - 알렉산더 노박 러시아 에너지장관, '약 2년 동안 지속한 가격 하락을 막기 위해 주요 산유국들이 협력할 필요가 있다'는 기존의 입장 반복

* <국제 금값> 미국 달러화 강세에도 실질 수요를 바탕으로 한 매입세로 강보합세

WTI 50.85 (+0.4%)
 COMEX금 1267.70 (+0.01%)

5. 전일 국내 지표

코스피 2033.00 (-0.37%)
 코스닥 651.77 (-0.60%)
 원/달러 1134.90 (+7.40)
 KTB 110.45 (-0.12)
 LKTB 130.75 (-0.28)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리, 장중 상승 전환한 후 상승폭을 키워 마감. 단기물 수급 우려에 외인의 3년 국채선물 매도 & 현물 매도 등 복합적 작용

1y 1.3820% (+1.40bp)
 3y 1.3810% (+2.70bp)
 5y 1.4430% (+2.00bp)
 10y 1.6260% (+1.30bp)
 20y 1.6710% (+1.10bp)
 30y 1.6760% (+0.80bp)
 50y 1.6710% (+1.30bp)
 CD 1.3600% (+2.00bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1Y -3.90bp (+2.05bp)
 2Y -5.85bp (+1.10bp)
 3Y -2.35bp (+0.80bp)
 5Y -4.80bp (+0.50bp)
 10Y -15.10bp (-0.05bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 국채선물이 장 막판에 급 약세전환하면서 금리 상승 마감. 전반적으로 한산한 분위기.

* CRS, 금리 소폭 하락. 특이점 없음

*IRS 금리

1Y	1.3550%	(+3.75bp)
2Y	1.3375%	(+3.50bp)
3Y	1.3575%	(+3.50bp)
5Y	1.3950%	(+2.50bp)
7Y	1.4175%	(+2.00bp)
10Y	1.4750%	(+1.25bp)

1*2Y	-1.75	(-0.25bp)
2*3Y	2.00	(0.00bp)
2*5Y	5.75	(-1.00bp)
3*5Y	3.75	(-1.00bp)
5*7Y	2.25	(-0.50bp)
5*10Y	8.00	(-1.25bp)

*CRS 금리

1Y	1.1550%	(-0.50bp)
2Y	1.0350%	(0.00bp)
3Y	0.9900%	(0.00bp)
5Y	0.9550%	(-0.50bp)
7Y	0.9050%	(-1.00bp)
10Y	0.8900%	(-1.00bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* 존 윌리엄스 샌프란시스코 연은 총재 '늦기전에 점진적 금리 인상 타당'

- '경제 성장이 좋은 상황을 맞이한 상황에서 점진적인 인상 속도로 돌아가는 것이 의미가 있다'... 기준금리를 조만간 올리지 않으면 침체가 올 수 있다고 경고

* 역외 달러-위안 6.76위안 돌파... 역대 최저 (2010년 거래 시작한 이래 최저)

- 간밤 美 달러화의 강세 & 인민은행이 위안화 가치를 6년래 최저치로 재차 고시한 점도 위안화 약세 심리에 불을 붙혀

* 구로다 BOJ 총재 '추가 금융완화 보류 시사...물가 달성도 연기'

- '현재 경제, 물가, 금융 정세는 크게 변하지 않았다. 곧 뭔가 변화가 있다고 보기 어렵다'며 현행 정책 기조를 유지할 것임을 드러냄

- '물가목표 2% 달성 시기는 수정이 있을 수 있다'며 내년 중이었던 목표기한이 2018년 이후로 연기될 가능성 제시

* S&P, 프랑스 신용등급 전망 '안정적' 상향

- 지난 2년 동안 도입한 노동시장 및 세금 개혁을 전망 상향의 배경이라고 설명

* 피치, 이탈리아 등급전망 '부정적' 하향...등급 'BBB+' 유지

- 이탈리아의 내년 정부 재정적자가 기존 국내총생산(GDP)의 1.8%에서 2.3%로 확대되는 등 전반적인 전망치가 기존보다 악화됐다고 평가

[국내]

* 건설·조선사 18.5%, 반기보고서 공시 미흡

* 임종룡 금융위원장 "여전업계, 해외에서 성장 기회 찾아야"

** 주간 예정 지표**

10월 24일

[윌리엄 더들리 뉴욕 연은 총재 연설]

[제임스 볼라드 세인트루이스 연은 총재 연설]

[찰스 에번스 시카고 연은 총재 연설]

[제롬 파월 연방준비제도(연준) 이사 연설]

미국-10월 제조업 PMI (예상:51.6, 이전:51.5)

-9월 시카고 전미활동지수 (이전:-0.55)

유로존-10월 합성 PMI (예상:52.8, 이전:52.6)

-10월 제조업 PMI (예상:52.6, 이전:52.6)

-10월 서비스 PMI (예상:52.4, 이전:52.2)

독일-10월 제조업 PMI (예상:54.3, 이전:54.3)

-10월 서비스 PMI (예상:51.5, 이전:50.9)

일본-9월 무역수지 (예상:342B, 이전:-19B)

-9월 수출 (예상:-10.4%, 이전:-9.6%)

-9월 수입 (예상:-16.6%, 이전:-17.3%)

10월 25일

[마크 카니 BOE 총재 기자회견]

한국-GDP(YoY) (이전:3.3%) / (MoM) (이전:0.8%)

미국-8월 주택가격지수(YoY) (이전:5.8%)

-8월 케이스-실러 주택가격지수(YoY) (예상:5.1%, 이전:5.0%)

-10월 CB 소비자신뢰지수 (예상:101.5, 이전:104.1)

독일-10월 Ifo 기업환경지수 (예상:109.5, 이전:109.5)

10월 26일

호주-3분기 CPI(QoQ) (예상:0.5%, 이전:0.4%)

미국-10월 서비스 PMI (예상:52.5, 이전:52.3)

-9월 신규주택판매 (예상:600K, 이전:609K)

-9월 신규주택판매(MoM) (예상:-1.0%, 이전:-7.6%)

-EIA 주간 원유재고

독일-11월 GfK 소비자신뢰지수 (예상:10.0, 이전:10.0)

10월 27일

[스웨덴/노르웨이 기준금리 결정]

미국-9월 내구재수주(MoM) (예상:0.2%, 이전:0.1%)

-9월 근원 내구재수주(MoM) (예상:0.2%, 이전:-0.2%)

-실업수당청구건수 (이전:260K)

-9월 펜딩주택판매(MoM) (예상:1.2%, 이전:-2.4%)

영국-3분기 GDP(QoQ) (예상:, 이전:0.7%) / GDP(YoY) (예상:, 이전:2.1%)

10월 28일

[러시아 기준금리 결정]

미국-3분기 GDP(QoQ) (예상:2.5%, 이전:1.4%)

-10월 미시간대 소비자심리지수 (예상:88.2, 이전:87.9)

-3분기 고용비용지수 (예상:0.6%, 이전:0.6%)

일본-10월 근원 CPI(YoY) (예상:-0.5%, 이전:-0.5%)

-9월 실업률 (예상:3.1%, 이전:3.1%)

독일-10월 CPI(MoM) (예상:0.1%, 이전:0.1%)