

1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가격, 뉴욕증시 상승과 연준 위원들의 매파 발언으로 하락

* 국채가, 이번주 대규모 입찰 부담에다 뉴욕증시 상승, 마르키트 제조업 지표 상승으로 하락 출발

* 연준 위원들의 11월 금리 인상 지지 발언도 국채가 낙폭을 더 확대하게 했으나 세인트루이스 연은의 제임스 볼러드 총재의 기본 성향이 비둘기여서 영향은 제한적

- 세인트루이스 연은 제임스 볼러드 총재 '저금리 앞으로 2~3년 동안 지속할 것 같다'는 기존 견해를 되풀이하면서도 11월 기준금리 인상을 지지한다고 밝혀

- 시카고 연은 찰스 에번스 총재 '미국의 국내 총생산이 올 하반기에 2%~2.5%를 기록하고 내년에도 이같은 성장이 유지되는 것을 전제로 내년 말까지 3차례 정도의 금리 인상을 예상'

* 美 재무부, 25일부터 사흘 연속으로 총 1천30억달러 규모의 국채 입찰

- 첫째날에는 2년물 \$260억어치 / 26일은 5년물 \$340억어치와 2년물 변동금리부(FRN) 국채 \$150억어치를 입찰 / 마지막에는 7년물 \$280억어치 입찰

[미국]

2y 0.84% (+1.7bp)

5y 1.27% (+3.1bp)

10y 1.76% (+3.0bp)

30y 2.52% (+3.2bp)

[기타 10Y물]

영국 1.09% (-0.6bp)

독일 0.02% (+1.8bp)

프랑스 0.30% (+2.0bp)

이탈리아 1.39% (+1.6bp)

스페인 1.10% (-1.2bp)

그리스 8.27% (-1.8bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 연이은 대형 M&A 소식과 기업 실적 호조에 상승...국제 유가 하락과 달러 강세로 인해 상승 폭 제한

* 미국 2위 통신업체 AT&T가 지난 22일 미디어·엔터테인먼트 기업인 타임워너를 총 854억 달러(약 97조 원)에 인수 합의 발표

미국의 항공기 부품 제조업체 록웰 콜린스, 항공기 내장재 제조사 B/E 에어로스페이스를 64억 달러

에 인수 합의

온라인 증권사인 TD 아메리트레이드, 경쟁업체인 스콧트레이드 파이낸셜 서비스를 40억달러(약 4조 5320억원)에 인수 협상

* 이라크 석유 장관은 이슬람국가(IS)와 싸우기 위해 더 많은 자금이 필요한 만큼 감산에서 제외해 줄 것을 요청

... 쿠싱 지역의 원유 재고가 약 100만배럴 감소했다는 소식에 유가 낙폭 제한

* 달러, 경기 지표 호조 영향으로 또 다시 8개월 만에 최고치...달러 인덱스, 전거래일 대비 0.1% 상승한 98.75

- 美 10월 제조업 PMI 예비치 53.2...전월치와 전망치인 51.5 상회

* <유럽 마감> 경기지표 호조에도 불구하고 혼조 마감...은행주, 브렉시트 이전 수준 회복

- 유로존 10월 종합 PMI 잠정치 53.7로 전월(52.6)과 전망치(52.8) 상회...10개월만에 최고수준

* <상하이 마감> 정부의 새로운 경기부양책 실시에 대한 기대감으로 주말의 상승세를 이어간 채 장을 마감

- 최대 연례 정치행사인 중국공산당 제18기 중앙위원회 제6차 전체회의(6중전회) 개막으로 새로운 경기대책이 나올 것이라는 관측이 확산

* <도쿄 마감> 일본은행이 상장투자신탁(ETF)을 매입할 것이란 전망에 단기 시세차익을 노리는 매수세가 일면서 주가 상승

DOW30	18223.03	(+0.43%)
NASDAQ	5309.83	(+1.00%)
S&P500	2151.33	(+0.47%)
NIKKEI225	17234.42	(+0.29%)
SHANGHAI	3128.25	(+1.21%)
FTSE100	6986.40	(-0.49%)
DAX30	10761.17	(+0.47%)
CAC40	4552.58	(+0.36%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 제조업 지표 상승과 연준 위원의 발언으로 연내 기준금리 인상 가능성이 커져 주요 통화에 상승

유로/달러	1.0880	(-0.0003)
유로/엔	113.34	(+0.32)
달러/엔	104.17	(+0.39)
달러/위안	6.7690	(+0.0132)

파운드/달러 1.22329 (+0.00049)
NDF 1135.50 / 1136.50원...4.70원 상승

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 이라크 등이 감산 합의에서 제외를 요청하는 등 석유수출국기구(OPEC)의 산유량 동결 합의가 이행되기 어려울 수 있다는 우려로 하락

* <국제 금값> 미국의 제조업 활동 호조에 따른 달러화 강세 등에 하락

WTI 50.52 (-0.7%)
COMEX금 1263.70 (-0.3%)...일주일래 최저치

5. 전일 국내 지표

코스피 2047.74 (+0.73%)
코스닥 647.88 (-0.60%)
원/달러 1131.00 (-3.90)
KTB 110.52 (+0.07)
LKTb 131.17 (+0.42)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리가 장중 변동성 끝에 하락 마감. 외인 매수가 견조하게 나타나면서 국채선물 역시 장 막판 상승폭을 키우며 장중 고점으로 마감. 그 동안 약세가 이어진 데 따른 강세 되돌림이 나타남.

1y 1.3930% (+1.10bp)
3y 1.3850% (+0.40bp)
5y 1.4370% (-0.60bp)
10y 1.6120% (-1.40bp)
20y 1.6720% (+0.10bp)
30y 1.6750% (-0.10bp)
50y 1.6680% (-0.30bp)
CD 1.3700% (+1.00bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1Y	-4.30bp	(-0.40bp)
2Y	-7.45bp	(-1.60bp)
3Y	-4.75bp	(-2.40bp)
5Y	-6.70bp	(-1.90bp)
10Y	-16.95bp	(-1.85bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 국채선물 강세로 하락 마감. 5년물 이하 구간으로 거래가 있는듯 했으나 전반적으로 잠잠한 분위기.

* CRS, 조용한 분위기에 소폭 하락 마감.

*IRS 금리

1Y	1.3600%	(+0.50bp)
2Y	1.3275%	(-1.00bp)
3Y	1.3375%	(-2.00bp)
5Y	1.3700%	(-2.50bp)
7Y	1.3900%	(-2.75bp)
10Y	1.4425%	(-3.25bp)

1*2Y	-3.25	(-1.50bp)
2*3Y	1.00	(-1.00bp)
2*5Y	4.25	(-1.50bp)
3*5Y	3.25	(-0.50bp)
5*7Y	2.00	(-0.25bp)
5*10Y	7.25	(-0.75bp)

*CRS 금리

1Y	1.1500%	(-0.50bp)
2Y	1.0300%	(-0.50bp)
3Y	0.9800%	(-1.00bp)
5Y	0.9450%	(-1.00bp)
7Y	0.8900%	(-1.50bp)
10Y	0.8750%	(-1.50bp)

9. 주요뉴스

[해외]

- * 일본 9월 무역수지, 2개월만에 흑자 전환...엔고로 인해 수입과 수출 모두 정체
 - 9월 무역수지 4,983억엔 흑자...시장 예상치인 3,729억엔 상회
 - 9월 수출, 해외 수요 부진 & 엔화 강세에 전년 대비 6.9% 감소하며 시장전망치 -10.8% 하회했지만 12개월 연속 감속 행보
 - 같은 기간 수입이 크게 줄면서 수출 감소 상쇄...전년대비 16.3% 감소
- * 中 위안화 가치 0.2% 절하 고시...6년 만에 최저치 경신
 - 고시 위안화 가치가 6년 만에 최저치를 계속 경신하고 있는 것은 美 금리 인상 기대 상승과 ECB의 통화완화 지속 전망으로 달러화 가치가 7개월 만에 최대 강세를 보이는데 따른 것으로 풀이
- * 스페인, 지난해 12월 총선 이래 10개월간 이어진 '무정부상태'종지부
 - 중도좌파 사회당, 당내 투표결과 국민당의 마리아노 라호이 총리대행이 이끄는 보수 정부 출범 사실상 승인
 - 하지만 과반을 확보하지 못한 집권 여당은 사사건건 야당에 발목 잡히게 되고, 독립을 주창하는 카탈루냐 여론 등 스페인 정정 불안은 계속될 가능성은 지속

[국내]

- * 채권시장 "국고 20년 입찰 무난...PD 참여"
 - 국고채 20년물(국고01500-3609) 경쟁입찰, 5천500억원이 가중평균금리 연 1.690%에 낙찰
 - 지난 주말 국고채 20년물 고시금리(1.671%)보다 1.9bp 높은 수준
- * 정부, 파산배당금 등 공적자금 67억 회수

금일 예정 지표

[마크 카니 BOE 총재 기자회견]

한국-GDP(YoY) (예상:2.6%, 이전:3.3%) / (QoQ) (예상:0.6%, 이전:0.8%)
미국-8월 주택가격지수(YoY) (이전:5.8%)
-8월 케이스-실러 주택가격지수(YoY) (예상:5.0%, 이전:5.0%)

-10월 CB 소비자신뢰지수 (예상:101.0, 이전:104.1)
독일-10월 Ifo 기업환경지수 (예상:109.5, 이전:109.5)