1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가격, 연준의 12월 기준금리 인상 확률이 80%에 육박했지만 10월 소비자신뢰지수가 부진하면서 단기물은 내리고 장기물은 오르는 혼조세 마감

* 국채가격, 오후 예정된 2년물 입찰 부담 속에 12월이 금리 인상 적기라고 언급한 연준 위원 발언에다 주택가격 상승으로 하락 출발했다가 소비자신뢰지수 부진으로 급반등하는 등 방향성 잃은 모습 보임
  - 이날 호황을 보여준 주택지표 발표 이후 11월 미국 대통령 선거를 앞두고 나온 침체된 소비자신뢰지수 지표는 국채가 변동성을 높임

* 연방기금(FF) 금리선물시장, 12월 기준금리 인상 가능성을 78%로 전일의 74%에서 높임...지난주 금리 인상 가능성 69% <CME 페드워치>

* 국채가는 오후 들어 2년물 입찰에서 연내 금리 인상 우려로 수요가 강하지 않은 것이 확인되면서 한때 반락하기도 함
  - 美 재무부, $260억 어치의 2년 만기 국채를 연 0.855%에 발행...입찰 수요 강도를 측정하는 응찰률은 2.53배로 지난 7월 이후 가장 낮은 수준

* 10년과 2년물 국채수익률 차이는 90bp로 전일의 92bp에서 줄어, 수익률 곡선이 평탄화됨

[미국]
2y 0.85% (+1.2bp)
5y 1.27% (+0.0bp)
10y 1.76% (-0.9bp)
30y 2.50% (-1.9bp)

[기타 10Y물]
영국 1.09% (+0.7bp)
독일 0.03% (+0.7bp)
프랑스 0.30% (+0.4bp)
이탈리아 1.38% (-0.8bp)
스페인 1.08% (-2.1bp)
그리스 8.21% (-5.8bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 엇갈린 기업실적과 부진한 경제지표에 하락 마감... 국제유가가 1% 넘게 떨어진것도 한몫

* 3M, 연간 실적 전망을 하향 조정... 주가 3% 떨어지며 다우 지수 하락을 이끔

가전업체 월풀, 달러 강세의 영향으로 매출이 기대에 못 미치면서 10.8% 급락
제약업체 머크, 3분기 순익이 22억달러로 일 년 전의 18억달러보다 증가해 주가 2.0% 상승

* 업종별로는 소비재 업종이 1.19% 하락했고 원자재 업종도 0.99% 하락... S&P500 전체 11개 업종 가운데 2개 업종만 상승하는데 그침

* 엇갈린 美 경제지표
- 10월 소비자신뢰지수 98.6 기록... 전월 수정치 103.5에서 크게 하락했을 뿐더러 시장 전망치 101.5에도 못 미친 결과
- S&P/케이스·실러 주택가격지수, 지난 8월 전년 대비 5.1% 상승... 지난 5월 5.3% 오른 것에 비하면 조금 낮은 수준이지만 수개월째 5% 대의 상승률 기록하며 안정적 상승세

* <유럽 마감> 獨 경제지표 호조에도 불구하고 기업 실적 부진에 혼조
- 스위스 반도체 회사인 AMS 3분기 실적 악화 악재로 주가 12.75% 급락
- 이탈리아의 방카 몬데 데이 파치 디 시에나가 2600명 규모의 감원과 500개 지점 폐쇄를 포함한 구조조정 계획을 발표하면서 주가가 14.99% 하락한것도 악재로 작용

* <상하이 마감> 공산당 제18기 중앙위원회 6차 전체 회의(18기 6중전회)에서 사회 기반 시설 투자 등 부양 정책이 나올 것이라는 기대감에 이틀째 상승세
- 정부가 인프라에 대한 투자를 늘릴 것이라는 계획을 발표하자 국영기업 중심으로 강세장을 견인

* <도쿄 마감> 일본 기업들의 3분기 실적발표가 진행되는 가운데 엔 약세로 수출주의 수익 기대감이 높아지며 상승 마감

DOW30	18169.27	(-0.30%)
NASDAQ	5283.40	(-0.50%)
S&P500	2143.16	(-0.38%)
NIKKEI225	17365.25	(+0.76%)
SHANGHAI	3131.94	(+0.12%)
FTSE100	7017.64	(+0.45%)
DAX30	10757.31	(-0.04%)
CAC40	4540.84	(-0.26%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 연준의 12월 기준금리 인상 가능성이 78%로 상승했음에도 엔화에는 소폭 오르고, 유로화에는 내리는 보합권 혼조

유로/달러	1.0886	(+0.0006)
유로/엔	113.46	(+0.12)
달러/엔	104.22	(+0.05)

달러/위안 6.7744 (+0.0054)
파운드/달러 1.21886 (-0.00443)
NDF 1130.00 /1131.00원...3.20원 하락

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 달러화 강세 지속과 이라크의 감산 참여 이탈 가능성에 따른 OPEC의 전체 산유량 동결 가능성 약화 등으로 하락
* <국제 금값> 연준의 연내 금리인상 전망에 따른 달러 강세에도 견조한 수요가 이어져 상승

WTI 49.96 (-1.1%)...2주만에 최저치
COMEX금 1273.60 (+0.8%)...약 3주만에 최고치

5. 전일 국내 지표

코스피 2037.17 (-0.52%)
코스닥 640.17 (-1.19%)
원/달러 1133.50 (+2.50)
KTB 110.43 (-0.09)
LKTB 130.80 (-0.37)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리, 미 금리인상 가능성 재차 반영 & 시장 기대치 웃돈 3분기 한국 성장률 영향으로 상승.
- 외인은 3년, 10년 국채선물을 모두 순매도. 특히 6거래일 연속 순매수행진을 멈추고 매도로 돌아서면서 약세 흐름 주도
- 이날부터 약 3일동안 진행되는 부가세 납부 이슈로 단기물 약세도 이어져

* 한국 3분기 경제성장률 컨센서스 & 결과

기 관	전분기대비	전년동기대비
연 합	+0.55%	+2.45%
로이터	+0.60%	+2.60%
블 룸	+0.60%	+2.60%
평 균	(+)0.58%	(+)2.55%
결 과	(+)0.70%	(+)2.70%

(정부소비와 건설투자 증가의 영향)

1y 1.4080% (+1.50bp)
3y 1.3980% (+1.30bp)
5y 1.4600% (+2.30bp)
10y 1.6400% (+2.80bp)
20y 1.6920% (+2.00bp)
30y 1.6930% (+1.80bp)
50y 1.6860% (+1.80bp)
CD 1.3800% (+1.00bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1Y -4.00bp (+0.30bp)
2Y -6.05bp (+1.40bp)
3Y -3.05bp (+1.70bp)
5Y -5.75bp (+0.95bp)
10Y -15.50bp (+1.45bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 국채선물 약세로 상승 마감. 오전에는 전반적으로 거래가 없이 조용했으나 오후 들어 2·3년물 중심으로 거래가 있던 것으로 보임.
* CRS, 거래가 부진한 가운데 금리 소폭 상승.

*IRS 금리

1Y 1.3800% (+2.00bp)
2Y 1.3575% (+3.00bp)
3Y 1.3675% (+3.00bp)
5Y 1.4025% (+3.25bp)
7Y 1.4250% (+3.50bp)
10Y 1.4850% (+4.25bp)

1*2Y -2.25 (+1.00bp)
2*3Y 1.00 (0.00bp)
2*5Y 4.50 (+0.25bp)

3*5Y 3.50 (+0.25bp)
5*7Y 2.25 (+0.25bp)
5*10Y 8.25 (+1.00bp)

*CRS 금리

1Y 1.1450% (-0.50bp)
2Y 1.0350% (+0.50bp)
3Y 0.9900% (+1.00bp)
5Y 0.9600% (+1.50bp)
7Y 0.9050% (+1.50bp)
10Y 0.8900% (+1.50bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* 존 윌리엄스 샌프란시스코 연은 총재 '올해 한 차례 기준금리 인상을 예상한다며 연준이 다음번 인상에 나서기 가장 좋은 시기는 12월일 것'

* ECB 드라기 총재, '아직 때 아니지만 마이너스 금리 부작용 걱정된다'
- '물가를 2% 바로 아래서 유지하는 ECB의 목표를 달성하는 데 필요한 통화완화 정책을 유지하겠다'
- 다만 '부작용이 축적될 수 있기 때문에 낮은 금리 상황을 과도하게 장기적으로 유지하지 않는 걸 선호하지 않는다'며 부작용 축적 우려감 표명

* 독일 기업들의 경기 신뢰도, 2년6개월만의 최고치
- 10월 IFO 기업환경지수 110.5 집계...전문가 전망치 109.3을 웃돈 결과로, 전달대비 1.0포인트 오른 수준

* BOE 마크 카니 총재 '금융시장 참가자들, 중앙은행의 물가 목표 사수에 변화가 있다고 생각할 필요가 없다'
- 카니 총재 발언에 앞서 英 재무장관의 BOE 통화완화 정책을 지지하는 발언으로 파운드화는 달러화에 1.20818달러로 개장 초보다 거의 1% 급락

* 중국 위안화, 3거래일 연속 절하되며 6년래 최저치 경신...25日 인민은행, 달러-위안 기준환율 전날보다 0.0054위안 올린 6.7744위안 고시
- 2010년 9월 9일(6.7817위안) 이후 최저치를 재차 경신
- 전날 美 달러지수가 지난 2월 이후 최고치인 98.84를 기록하면서 위안화가 약세 압력을 받은 것으로 풀이

[국내]

* 세계은행, 韓 '기업하기 좋은 나라' 5위...한계단 하락
- 뉴질랜드(1위), 싱가포르(2위), 덴마크(3위), 홍콩(4위)과 함께 3년 연속 톱5 유지

* 韓—이란 금융 협력 세미나...채권거래·결제 사업 박차

* 금리상승에 배당까지...다시 떠오르는 보험주
- 금리상승으로 역마진이 줄어들고 있는 가운데 연말 배당 기대 심리에 힘입어 상승

금일 예정 지표

호주-3분기 CPI(QoQ) (예상:0.5%, 이전:0.4%)
미국-10월 서비스 PMI (예상:52.3, 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)