

1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가격, 월말 포트폴리오 조정용 매수세에 상승

* 국채가격, 혼조적인 9월 개인소비지출(PCE) 지수가 발표된 가운데 美 대통령 선거 불확실성 탓에 안전자산 선호가 지속하고 월말 포트폴리오 조정용 매수세가 나와 오름폭을 확대

* 美 10월 시카고 지역의 제조업 활동이 생산 및 신규주문 감소로 시카고 PMI가 50.6으로 5개월래 최저치로 하락하며 국채가 오름폭 커짐

* 오후 들어 국채가격 오름폭을 줄이는 듯하다가 뉴욕증시의 반락과 포트폴리오 조정용 매수, 뉴욕유가 급락으로 다시 확대

[미국]

2y 0.84% (-1.2bp)

5y 1.31% (-1.8bp)

10y 1.83% (-2.1bp)

30y 2.58% (-3.6bp)

[기타 10Y물]

영국 1.24% (-1.5bp)

독일 0.16% (-0.4bp)

프랑스 0.46% (+0.0bp)

이탈리아 1.66% (+0.7bp)

스페인 1.19% (-3.1bp)

그리스 8.15% (-6.4bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 대형 M&A 소식과 소비지출 증가 영향으로 상승 출발했지만 국제 유가 급락 & FBI의 힐러리 클린턴 민주당 대선 후보의 'e메일 스캔들'에 대한 재조사에 따른 불안감이 맞물리면서 하락 반전

* 제너럴일렉트릭(GE), 대형 유전서비스업체 베이커휴즈를 300억달러(약 34조2300억원)에 인수
美 통신업체 센추리링크, 경쟁업체 레벨3커뮤니케이션을 주당 66.50달러에 인수

* OPEC 회원국들과 비회원국들, 지난 주말 오스트리아 빈에서 회동했지만 다음 달 30일 예정된 공식 회담 전 한 번 더 만나는 데에만 동의했을 뿐 생산량 조정 등 구체적인 성과를 내지 못해... 미국 커싱 지역의 원유 재고 증가도 악재로 작용해 유가 3.8% 급락

* 미국 경제의 약 70%를 차지하는 개인소비증가세 전환

- 9월 개인소비지출(PCE), 전월대비 0.5% 증가...전망치(0.4%) 상회
하지만 8월에는 전월과 변화가 없던 기준발표치가 0.1% 감소로 수정
- 9월 PCE 가격지수, 전월 대비 0.2%, 전년 대비 1.2% 각각 상승... 전년 대비 상승 폭은 2014년 11월 이후 최고치
- 근원 PCE 물가지수 전월대비 0.1% 상승해 전망치 부합... 전년대비 역시 1.7% 상승률을 기록해 전망과 동일한 수준

* <유럽 마감> 美 대선 불안감 & 국제 유가 급락으로 하락 마감... 에너지 업종 -1.4%

* <상하이 마감> 시진핑 중국 국가주석이 자산 거품 경고하며 투자심리 위축으로 하락...美대선을 둘러싼 불확실성이 높아진것도 악재로 작용

- 지난 28일 시진핑 '신중한 통화정책을 지속하고, 계속해서 충분한 유동성을 공급해야 한다...동시에 자산 거품을 관리하는 것에 집중하며, 경제 및 금융 위험을 방지해야 한다'고 발언

* <도쿄 마감> 미국 대통령 선거를 둘러싼 불확실성이 다시금 높아지면서 투심 위축... 보험 혼조 마감

- 일본과 미국의 통화정책회의를 앞둔 관망세도 증시에 부담

DOW30	18142.42	(-0.10%)
NASDAQ	5189.14	(-0.02%)
S&P500	2126.15	(-0.01%)
NIKKEI225	17425.02	(-0.12%)
SHANGHAI	3100.49	(-0.12%)
FTSE100	6954.22	(-0.60%)
DAX30	10665.01	(-0.29%)
CAC40	4509.26	(-0.86%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 힐러리 클린턴 민주당 대통령 후보의 지지율이 여전히 도널드 트럼프 공화당 후보보다 앞선 것으로 확인되면서 상승

유로/달러	1.0980	(-0.0002)
유로/엔	115.05	(+0.03)
달러/엔	104.81	(+0.13)
달러/위안	6.7641	(-0.0217)
파운드/달러	1.22374	(+0.005505)
NDF	1143.00 / 1144.80원...1.15원 하락	

4.글로벌 상품

* <국제 유가> OPEC 회원국 등 주요 산유국들이 지난 주말 회동에서 감산과 관련한 구체적인 합의를 끌어내지 못한 데 따라 하락

* <국제 금값> Fed의 통화정책 회의와 미국 대선을 기다리는 가운데 달러화 강세로 하락

WTI 46.84 (-3.8%)
COMEX금 1274.30 (-0.2%)

5. 전일 국내 지표

코스피 2008.19 (-0.56%)
코스닥 624.68 (-2.42%)
원/달러 1144.50 (-0.40)
KTB 110.34 (+0.09)
LKTb 130.23 (+0.58)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리, 월말 원도드레싱 성격의 매수가 유입되면서 하락 마감. 외인은 3년, 10년 국채선물을 모두 순매수.

- 장중 외신(WSJ)에서 11월 FOMC가 실망스러울 가능성이 있고, 인상 시그널이 없을 것이라는 보도에 국채선물 상승폭 키워

CD(91d) 1.3900% (0.00bp)
1y 1.4190% (-0.40bp)
3y 1.4380% (0.00bp)
5y 1.5010% (-2.00bp)
10y 1.6880% (-3.00bp)
20y 1.7510% (-1.70bp)
30y 1.7690% (-0.80bp)
50y 1.7560% (-1.30bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1Y -5.55bp (-0.65bp)
2Y -9.30bp (-1.95bp)
3Y -6.30bp (-3.00bp)

5Y -8.10bp (-2.25bp)
10Y -17.30bp (-2.25bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 10년 국채선물 강세로 하락 마감. 국내외 여건이 비드보다는 오퍼가 강했던 분위기.

* CRS 금리도 전 구간에 걸쳐 하락. 4년~10년물 2bp씩 고르게 하락.

*IRS 금리

1Y 1.3725% (-1.75bp)
2Y 1.3550% (-2.75bp)
3Y 1.3750% (-3.00bp)
5Y 1.4200% (-4.25bp)
7Y 1.4500% (-5.00bp)
10Y 1.5150% (-5.25bp)

1*2Y -1.75 (-1.00bp)
2*3Y 2.00 (-0.25bp)
2*5Y 6.50 (-1.50bp)
3*5Y 4.50 (-1.25bp)
5*7Y 3.00 (-0.75bp)
5*10Y 9.50 (-1.00bp)

*CRS 금리

1Y 1.0800% (-1.00bp)
2Y 0.9700% (-1.50bp)
3Y 0.9300% (-1.50bp)
5Y 0.9050% (-2.00bp)
7Y 0.8550% (-2.00bp)
10Y 0.8550% (-2.00bp)

9. 주요뉴스

[해외]

- * 마크 카니 BOE 총재, 브렉시트에 따른 혼란을 최소화하기 위해 임기를 1년(2019년 6월까지) 연장
 - '영국이 유럽연합(EU)과 새로운 관계를 맺는 과정에서 질서 있는 전환에 기여하고자 한다' 고 밝혀
 - 파운드화, 마크 카니 BOE 총재의 임기 연장 소식이 전해진 후 미 달러화에 대해 한때 1.22490달러로 전장대비 0.50% 상승
- * 유로존 3분기 GDP 성장률 잠정치, 전분기대비 0.3% 집계... 지난 2분기 성장률 및 시장 전망치와 동일한 결과
 - 10월 소비자물가지수는 전년 같은달 대비 +0.5%... 2014년 6월 이후 최고치
- * 일본 소매판매, 지난 3월부터 9월까지 7개월 연속 감소세
 - 9월 소매판매, 지난해 같은 기간보다 1.9% 감소한 11조230억엔 기록 (전망치 -1.8%를 밑돌지만 전월치 -2.1% 웃도는 수준)
 - 9월 산업생산은 전월대비 보합세 (97.8)...시장 예상치 +1.0% 하회
- * 스탠더드앤드푸어스(S&P), 호주 25개 금융기관의 신용등급 전망을 '안정적'에서 '부정적'으로 하향
 - '민간부문 부채와 주거용 부동산 가격의 강한 상승으로 호주에서 영업 중인 모든 금융기관이 직면한 경제적 위험이 증가하고 있다' 며 신용등급 전망을 내린 배경 설명

[국내]

- * 국고 3년 0.95조 1.435% 낙찰...응찰 3.656조
- * 한은 "통화정책 충격에 환율변동성 확대 유의"
 - 워싱턴주재원은 지난 26일 발표한 동향 분석 중 '통화정책 분기 환경 하에서 환율 반응확대'라는 자료를 통해 "미국, 유럽, 일본간 통화정책 다이버전스 심화가 예상되면서 통화정책 충격에 대한 금융변수의 민감도가 크게 상승했다"고 분석
- * 단기물 금리 상승 여파에...얼어붙는 CP시장
 - 단기물 금리상승과 연말이라는 시기적 특성까지 겹쳐 CP 투자·발행 수요가 위축된 것
 - 시중은행들의 CP매도도 영향
- * 정부, 조선 '빅3' 체제 유지...대우조선 매각 추진
 - 빅3 인력 32%·도크 23% 감축...해양플랜트 축소
 - 수주절벽 대응 2020년까지 11.2조 선박 250척 발주
 - 조선사 정상 수주 금융권 RG(은행보증·선수금 환급보증) 발급 적극 추진
- * 유일호 "조선 수주절벽 대응...2020년까지 11조원 규모에 달하는 250척 발주"

****금일 예정 지표****

[11월 美 FOMC 1일차]

[호주중앙은행(RBA) 기준금리 결정]

[BOJ 금융정책 결정회의 결과 발표]

미국-10월 ISM 제조업 PMI (예상:51.7, 이전:51.5)

-10월 제조업 PMI (예상:53.3, 이전:53.2)

-9월 건설지출(MoM) (예상:0.5%, 이전:-0.7%)

중국-10월 제조업 PMI (예상:50.4, 이전:50.4)

-10월 비제조업 PMI (이전:53.7)

-10월 caixin 제조업 PMI (예상:50.2, 이전:50.1)

한국-10월 CPI(YoY) (예상:1.2%, 이전:1.2%) / CPI(MoM) (예상:-0.1%, 이전:0.6%)

영국-10월 제조업 PMI (예상:54.5, 이전:55.4)

-9월 건설지출(MoM) (예상:0.5%, 이전:-0.7%)

중국-10월 제조업 PMI (예상:50.4, 이전:50.4)

-10월 비제조업 PMI (이전:53.7)

-10월 caixin 제조업 PMI (예상:50.2, 이전:50.1)

한국-10월 CPI(YoY) (예상:1.2%, 이전:1.2%) / CPI(MoM) (예상:-0.1%, 이전:0.6%)

영국-10월 제조업 PMI (예상:54.5, 이전:55.4)
