

1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가격, 美 FBI가 힐러리 클린턴 민주당 후보의 이메일 재수사를 종결하고 혐의가 없다고 발표함에 따라 위험자산 선호가 강해져 하락

* 국채가, 미 FBI의 클린턴 이메일 수사 종결 소식에 안전자산 선호 약화에 따른 매도세가 나와 하락 출발

* 클린턴의 지지율이 재상승했지만, 아직 두 후보간 격차가 크지 않은 데다 대선 결과가 9일해야 나오기 때문에 관망세가 짙어짐에 따라 거래는 많지 않았던 편
- 오후 들어 대선을 앞둔 경계로 게걸음 장세를 지속

* 3개월 만기 국채수익률, 예상보다 큰 재무부의 단기물 발행액 발표가 부담으로 작용한 데다 12월 인상 기대도 가세해 0.408%로 2008년 11월 이후 최고
- 美 재무부, 4주짜리 국채 2001년 이후 최대인 650억달러 발행 발표

[미국]

2y 0.82% (+3.2bp)

5y 1.29% (+5.4bp)

10y 1.83% (+5.0bp)

30y 2.60% (+4.0bp)

[기타 10Y물]

영국 1.20% (+7.3bp)

독일 0.15% (+1.9bp)

프랑스 0.46% (+0.5bp)

이탈리아 1.70% (-4.8bp)

스페인 1.24% (-2.5bp)

그리스 7.23% (-38.4bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 미국 대통령 선거를 둘러싼 우려가 완화한 데 따라 상승... 다우지수 지난 3월 이후 가장 큰 상승 폭을 기록

* 뉴욕 증시, 힐러리 클린턴 민주당 후보의 '이메일 스캔들' 재수사에서 무혐의 결론이 내려지면서 2% 넘게 급등...유럽 증시가 2% 가까이 급등한 것도 호재로 작용

* 대선 우려가 줄어들면서 시장 '공포지수'도 급락

- 시카고옵션거래소 변동성지수, 전 거래일보다 16.48% 하락한 18.80을 기록... 지난 6월 이후 가장 큰 하락 폭

* <유럽 마감> 미국 대선 불안감이 완화되면서 6주 만에 가장 큰 폭으로 상승

* <상하이 마감> 차익실형 매도세 불구하고 석탄과 철강주 주도로 상승

- 리커창 中 총리가 지난 5일 '적절한 총수요 확대 정책과 공급측 구조 개혁을 통해 내재적 경제 발전 동력을 강화하겠다' 발언이 투자 심리를 북돋았음

* <도쿄 마감> FBI의 힐러리 클린턴 '이메일 스캔들 재수사'가 사실상 무혐의로 종결됐다는 소식에 상승...달러 강세로 달러/엔 환율이 오르자 수출주 오름세

DOW30	18259.60	(+2.08%)
NASDAQ	5166.17	(+2.37%)
S&P500	2131.52	(+2.22%)
NIKKEI225	17177.21	(+1.61%)
SHANGHAI	3133.33	(+0.26%)
FTSE100	6806.90	(+1.70%)
DAX30	10456.95	(+1.93%)
CAC40	4461.21	(+1.91%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 미국 FBI가 힐러리 클린턴 민주당 후보의 이메일 재수사를 무혐의로 종결하면서 12월 기준 금리 인상 기대가 높아져 상승

- 트럼프 후보의 당선은 경제 전망 불확실성을 높여, 12월 금리 인상 가능성을 낮춘다는 시장 논리 작동

유로/달러	1.1044	(-0.0093)
유로/엔	115.40	(+0.56)
달러/엔	104.48	(+1.38)
달러/위안	6.7725	(+0.0211)
파운드/달러	1.24038	(-0.01139)
NDF	1141.00 / 1142.00원...1.85원 하락	

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 美 대통령 선거 불안 완화에 따른 전반적인 자산 가격 상승과 미 커싱지역 지진에 따른 원유 공급 타격 우려 등으로 강세

* <국제 금값> 미국 민주당 대선 후보 힐러리 클린턴의 이메일 재수사가 무혐의로 결론이 난 데 따른 위험자산 선호로 하락

WTI	44.89	(+1.9%)
COMEX금	1279.40	(-1.9%)

5. 전일 국내 지표

코스피	1997.58	(+0.79%)
코스닥	622.17	(+1.86%)
원/달러	1143.10	(-0.30)
KTB	110.34	(+0.03)
LKTB	129.89	(-0.09)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리, 변동성 끝에 커브 스티프닝. 힐러리 클린턴의 이메일 스캔들 수사가 무혐의로 종결됐다는 소식에 약세로 출발했지만, 외인의 3년&10년 국채선물 순매수에 약세폭을 줄여 나감.

CD(91d)	1.3900%	(0.00bp)
1y	1.4210%	(-0.10bp)
3y	1.4260%	(-0.50bp)
5y	1.5250%	(+1.80bp)
10y	1.7070%	(+1.30bp)
20y	1.8070%	(+1.90bp)
30y	1.8330%	(+2.10bp)
50y	1.8240%	(+2.10bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1Y	-7.85bp	(+0.05bp)
2Y	-10.25bp	(+1.20bp)
3Y	-9.10bp	(+1.00bp)
5Y	-11.75bp	(-1.30bp)
10Y	-17.45bp	(-0.30bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 미국 대선을 앞두고 보험세 마감. 단기물 위주로만 거래. 경계심이 커 결과가 나오기전까지는 뚜렷한 방향을 잡기 어려움.

* CRS, IRS와 같이 소폭 상승하는 정도로 마감.

*IRS 금리

1Y	1.3475%	(-0.25bp)
2Y	1.3275%	(0.00bp)
3Y	1.3350%	(+0.50bp)
5Y	1.4075%	(+0.50bp)
7Y	1.4600%	(+0.50bp)
10Y	1.5325%	(+1.00bp)

1*2Y	-2.00	(+0.25bp)
2*3Y	0.75	(+0.50bp)
2*5Y	8.00	(+0.50bp)
3*5Y	7.25	(0.00bp)
5*7Y	5.25	(0.00bp)
5*10Y	12.50	(+0.50bp)

*CRS 금리

1Y	1.0350%	(0.00bp)
2Y	0.9400%	(+0.50bp)
3Y	0.9150%	(+0.50bp)
5Y	0.9000%	(+1.00bp)
7Y	0.8600%	(+1.00bp)
10Y	0.8650%	(+1.00bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* BOJ, 지난 9월 뚜렷한 반대 없이 원만하게 통화 정책의 틀 변경 <9월 의사록>

- 다수 위원은 장·단기 금리 조작을 정책의 핵심으로 삼아야 한다고 주장했으며 또 마이너스 금리 정책이 금융 기관의 수익에 미치는 영향을 주시해야 한다는 데 동조

* 英 고등법원이 브렉시트 추진에 제동을 거는 판결에 급등하고 있던 파운드화 가치, 메이 영국 총리

가 '하드 브렉시트' 추진에 강경한 입장을 보이며 상승세 주춤

- 지난 주말 테리사 메이 영국 총리 '브렉시트에 착수하는 것에 집중... 국민투표 결과는 명확하고, 합법적이었다' 고 발표

- '법원이 의회의 동의를 얻으라고 강요한다면 영국은 더욱 안 좋은 상황에 처할 것'

* 사빈 로텐슬레거 ECB 이사 '추가 금리 인하나 추가 통화완화 조치에 대해서 매우 회의적'

- 통화완화 정책의 효과는 시간이 갈수록 줄고, 위험은 커질 것이라고 언급

* 13개 통화로 구성된 통화 바스켓에 대한 중국 위안화 가치를 나타내는 'CFETS 위안화 환율지수' 93.78 로 전주대비 0.39% 하락...3주째 하락

[국내]

* 국고 5년 1.35조 1.54% (+3.3bp) 낙찰...응찰 4.928조

- 채권시장 "국고 5년 입찰 무난...시장 영향은 미미"

* 증권가에 퍼지는 '그레이트로테이션'...주식 전성기 올까

- 글로벌 금융위기 이후 채권시장에 집중됐던 자금이 내년부터 서서히 주식시장으로 유입될 것이란 관측이 확산

- 주요국의 확장적 재정정책과 미국의 기준금리 인상 방침 등이 원자재 가격 상승과 함께 국내외 위험 자산 선호 심리를 더욱 자극할 것이란 이유

- 그동안 미국의 기준금리 인상 시사에도 주요국의 확장적 통화정책 및 글로벌 저성장 기조 등에 '그레이트 로테이션'이 지연됐지만, 내년부터 점진적인 자금 이동이 일어날 수 있어

* 임종룡 "외화유동성 관리 강화...비상 조달계획 재점검"

금일 예정 지표

[미국 대통령 선거 1일차]

[찰스 에번스 시카고 연은 총재 연설]

[유럽연합(EU) 재무장관 회의]

미국-10월 NFIB 소기업낙관지수 (예상:94.6, 이전:94.1)

-9월 JOLT 구인자 (예상:5.508M, 이전:5.443M)

중국-10월 무역수지 (예상:51.70B, 이전:41.99B)

-10월 수출(YoY) (예상:-6.0%, 이전:-10.0%)

-10월 수입(YoY) (예상:-1.0%, 이전:-1.9%)

독일-9월 산업생산(MoM) (예상:-0.5%, 이전:2.5%)

-9월 무역수지 (예상:23.0B, 이전:22.2B)

-9월 수출(MoM) (예상:-0.8%, 이전:5.4%)

-9월 수입(MoM) (예상:-0.2%, 이전:3.0%)

영국-9월 산업생산(MoM) (예상:0.1%, 이전:-0.4%)

-9월 제조업생산(MoM) (예상:0.4%, 이전:0.2%)