

Eugene's FICC Update



유진투자증권

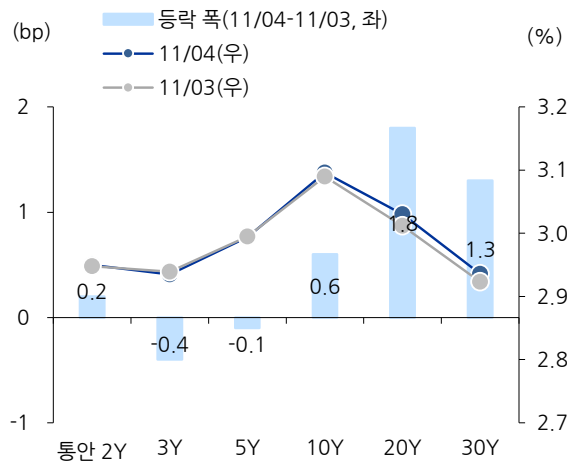
Fixed Income 김지나_02)368-6149_jnkim0526@eugenefn.com Economist 이정훈_02)368-6176_jhoonlee@eugenefn.com RA 유재혁_02)368-6177_dbwogur170@eugenefn.com

Fixed Income

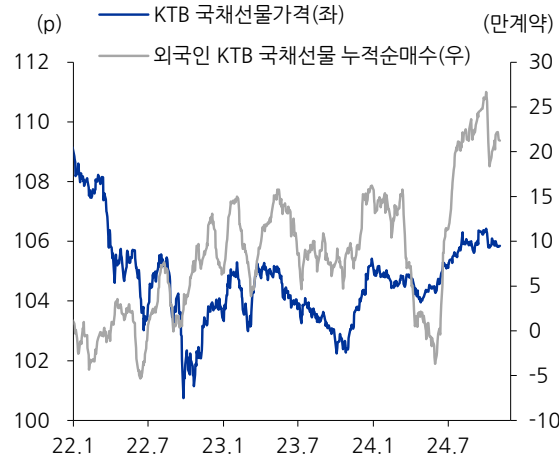
(단위: %,bp, 톱)

		11/4일	1D	1W	YTD
국내 채권	한국 국고채 3년물	2.935%	-0.4	0.3	-21.9
	한국 국고채 10년물	3.096%	0.6	-2.1	-8.7
	장단기금리차(10년-3년,bp)	16.1	15.1	18.5	2.9
	3년 국채 선물(KTB)	105.85	3.0	1.0	43
	10년 국채선물(LKTB)	116.20	-3.0	20.0	70
해외 채권	미국채 2년물	4.163%	-4.4	2.2	-8.7
	미국채 10년물	4.286%	-9.9	0.3	40.7
	장단기금리차(10년-2년,bp)	12.3	17.7	14.2	-37.1
	독일국채 10년물	2.389%	-1.6	10.3	38.5
	호주국채 10년물	4.561%	2.3	8.0	60.6

일간 금리 등락 폭 & 커브



외국인 3년 국채선물(KTB) 수급



외국인 10년 국채선물(LKTB) 수급



국내 채권시장 동향

- 국내 채권시장 혼조세 마감. 여전히 수급, 대외금리 연동되는 흐름 지속
- 국내 금리는 대외금리 연동되며 상승 출발하였으나 이내 오름폭을 축소. 저가매수세가 유입된 가운데 외국인 10년 국채선물 매수세도 확대된 영향
- 장 중 가격 견인할 재료는 부재. 미 대선 앞둔 경계감으로 적극적인 매매도 없었음. 오후에도 보합권 내 눈치 보기 장세가 이어짐

전망 및 향후 주요 이벤트

- 미국 채권시장 강세 마감.
- 미 대선 하루 남기고 트럼프 트레이드 되돌림이 나타남. 공화당 우호지역으로 알려진 아이오와주에서 해리스 지지율이 트럼프를 앞섰다는 여론조사가 주목 받음
- 국제유가 3% 가까이 급등하여 장기금리 추가 하락을 제함. 달러 강세, OPEC+ 원유 증산 지연된 영향
- 금일 미 대선, 미국 10월 ISM 서비스업 PMI, 중국 10월 차이신 서비스업 PMI, 국내 10월 CPI 등 예정

자료 출처: 연합인포맥스, Refinitiv, 유진투자증권

본 자료는 참고용 자료일 뿐이고, 특정주식에 대한 투자목적으로 작성된 것이 아닙니다. 본 자료는 담당자가 신뢰할 만하다고 판단하는 자료나 정보에 근거하여 작성되었지만, 그 정확성이나 완전성을 보장할 수는 없습니다. 따라서 본 자료를 참고한 고객의 투자 의사 결정은 고객 자신의 판단과 책임에 따라 이루어져야 하고, 당사는 본 자료의 내용에 의거하여 행하여진 일체의 투자행위의 결과에 대하여 책임을 지지 않을 것임을 밝힙니다. 아울러 본 자료는 당사 고객에게만 제공되는 자료로서 당사의 동의 없이 본 자료를 무단으로 복제/전송/인용/배포하는 행위는 법으로 금지되어 있습니다

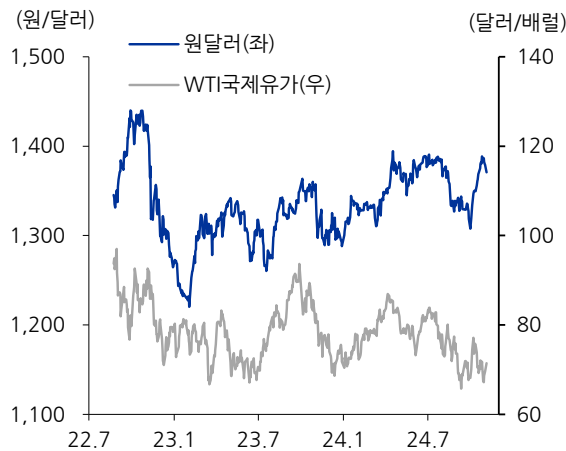


FX & Commodity

(단위: %, \$)

	11/4일	1D	1W	YTD
원/달러	1,370.90	-0.6%	-1.0%	6.4%
달러지수	103.91	-0.4%	-0.4%	2.6%
달러/유로	1.088	0.4%	0.6%	-1.6%
환율 위안/달러(역외)	7.11	-0.4%	-0.4%	-0.2%
엔/달러	152.15	-0.6%	-0.7%	8.0%
달러/파운드	1.295	0.2%	-0.2%	1.8%
헤알/달러	5.78	-1.4%	1.3%	19.2%
WTI 근월물(\$)	71.47	2.8%	6.1%	-0.3%
금 현물(\$)	2,737.48	0.0%	-0.2%	32.7%
구리 3개월물(\$)	9,676.00	1.1%	1.4%	13.1%

원달러 환율 및 국제유가 동향



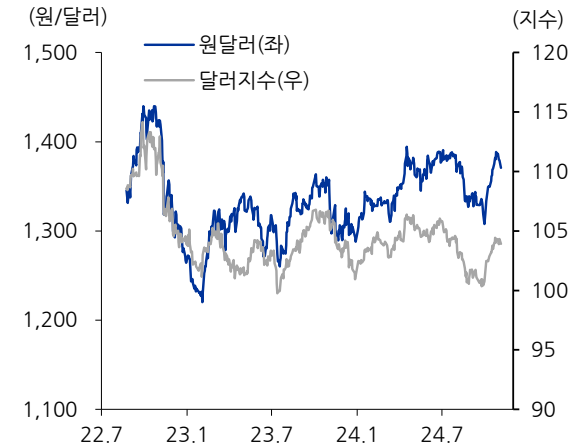
원달러 환율 및 위안달러 환율 동향



원달러 환율 동향

- 달러-원 환율은 서울 외환시장에서 -8.50원 하락한 1,370.90원에 마감. 야간거래에서는 1,375.50원 마감.
- 지난 주말 미국 고용 부진에도 달러는 소폭 강세. 그러나 미국 대선을 앞두고 트럼프 트레이드가 되돌림을 겪으면서 달러-원도 하락.
- 1,370원대 후반에서 개장 후 곧바로 낙폭을 확대하기 시작. 장중 더불어민주당이 금투세 폐지를 발표하면서 국내 주식도 상승폭 확대.

원달러 환율 및 달러지수 동향



달러 지수 동향 및 관전 포인트

- 달러 인덱스는 트럼프 트레이드 되돌림 속 하락.
- 전일 별다른 이벤트는 없었던 가운데, 대선 대기 심리가 장 움직임을 주도.
- 미국 대선을 하루 앞둔 가운데 일부 여론 조사에서 해리스가 주요 경합주에서 트럼프에 근소하게 앞선다는 조사가 나오기 시작하면서 그간 가파르게 진행되었던 트럼프 트레이드는 되돌림 지속.
- 금일 미국 대선 및 ISM 서비스업지수 발표 예정.