

Eugene's FICC Update



유진투자증권

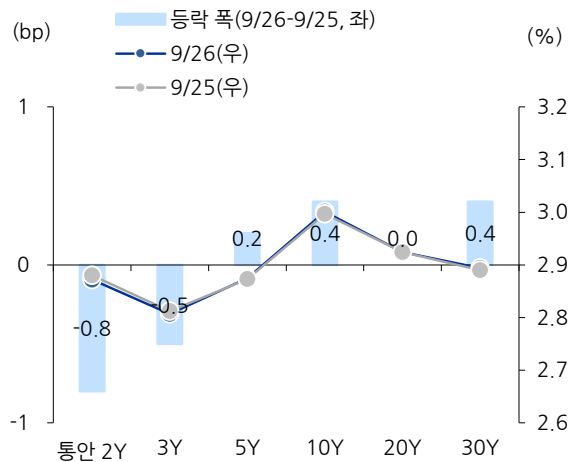
Fixed Income 김지나_02)368-6149_jnkim0526@eugenefn.com Economist 이정훈_02)368-6176_jhoonlee@eugenefn.com RA 유재혁_02)368-6177_dbwogur170@eugenefn.com

Fixed Income

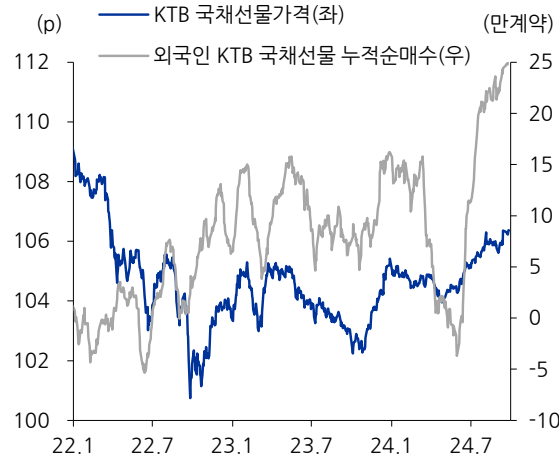
(단위: %,bp, 톱)

	9/26일	1D	1W	YTD
국내 채권	한국 국고채 3년물	2.807%	-0.5	-3.6
	한국 국고채 10년물	3.001%	0.4	2.2
	장단기금리차(10년-3년,bp)	19.4	18.5	13.6
	3년 국채 선물(KTB)	106.37	0.0	5.0
	10년 국채 선물(LKT)	117.32	-3.0	-23.0
해외 채권	미국채 2년물	3.630%	7.0	4.6
	미국채 10년물	3.797%	1.1	8.1
	장단기금리차(10년-2년,bp)	16.7	22.6	13.2
	독일국채 10년물	2.181%	0.4	-1.7
	호주국채 10년물	3.940%	3.3	1.2

일간 금리 등락 폭 & 커브



외국인 3년 국채선물(KTB) 수급



외국인 10년 국채선물(LKT) 수급



국내 채권시장 동향

- 국내 채권시장 혼조세 마감
- 한은 부총재보, 금통위는 금융안정도 중요한 고려사항이지만 물가와 성장 측면도 함께 고려할 것을 언급. 전일 신성한 금통위원에 이은 비둘기 발언으로 해석됨
- 이외 특별한 재료 부재하였고, 외국인 3년 국채선물 순매수하여 단기물 강세 지지

전망 및 향후 주요 이벤트

- 미국 채권시장 약세 마감.
- 실업수당청구건수, 5월 이후 최저치 기록하며 예상 하회. 다만 사우디 증산 계획 소식에 유가 3% 가량 급락하며 금리 상승폭 제한함
- 미셸 보먼 이사, 인플레이션이 2%를 상회하는만큼 금리 인하는 신중할 필요 재차 강조
- 금일 미국 8월 PCE, 미국 9월 미시간대 소비자신뢰지수, 한국 10월 제조업 BSI, 등 발표 예정

자료 출처: 연한인포맥스, 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 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

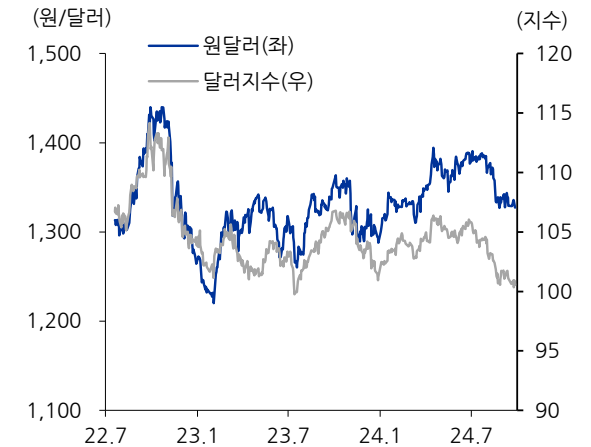
(단위: %, \$)

		9/26일	1D	1W	YTD
환율	원/달러	1,327.20	-0.3%	-0.1%	3.0%
	달러지수	100.56	-0.4%	-0.1%	-0.7%
	달러/유로	1.118	0.4%	0.1%	1.2%
	위안/달러(역외)	6.97	-0.9%	-1.4%	-2.1%
	엔/달러	144.81	0.0%	1.5%	2.8%
	달러/파운드	1.342	0.7%	1.0%	5.4%
	헤알/달러	5.44	-0.7%	0.3%	12.0%
상품	WTI 근월물(\$)	67.67	-2.9%	-5.9%	-5.6%
	금 현물(\$)	2,672.51	0.6%	3.3%	29.6%
	구리 3개월물(\$)	9,884.00	0.7%	3.9%	15.5%

원달러 환율 및 위안달러 환율 동향



원달러 환율 및 달러지수 동향



원달러 환율 및 국제유가 동향



원달러 환율 동향

- 달러-원 환율은 -3.80원 하락한 1,327.20원에 마감. 야간거래에서는 1,317.40원 마감.
- 달러-원, 중국 경기부양기대가 약화되어 소폭 상승하며 출발. 대신 장 초반이 고점으로, 장 중 하락 지속. 위안화 강세와 코스피 급등 영향
- 미국 마이크론 호실적에 삼성전자, SK하이닉스 등 국내 대형주 중심 외국인 매수세 유입되었고 원화도 강세. 중국, 대형 국유은행에 1조 위안 투입 검토 소식은 위안화를 거쳐 원화 강세요인으로 작용

달러 지수 동향 및 관전 포인트

- 달러 인덱스는 주요 경제지표, 연준 인사 발언 영향에 하락.
- 중국 재정 부양책 기대 이어지며 위안화 강세 보인 점이 달러인덱스에 부담으로 작용. 뉴욕 주식시장이 강세를 보이는 등 위험선호 분위기 연출된 점도 달러 압박
- 미셸 보먼, 물가에 대한 경계감을 여전히 드러내며 금리 인하에 신중해야함을 거듭 강조
- 실업수당청구건수, 전주보다 4,000건 가량 감소. 미 2분기 GDP 확정치는 잠정치와 같은 3.0%로, 1분기 1.6% 대비 크게 개선.