

Eugene's FICC Update



유진투자증권

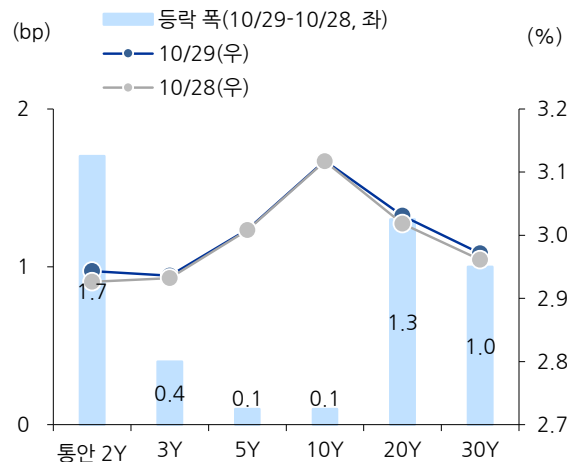
Fixed Income 김지나_02)368-6149_jnkim0526@eugenefn.com Economist 이정훈_02)368-6176_jhoonlee@eugenefn.com RA 유재혁_02)368-6177_dbwogur170@eugenefn.com

Fixed Income

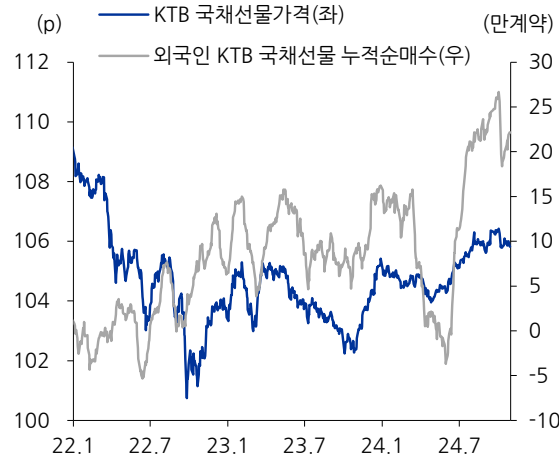
(단위: %,bp, 톱)

	10/29일	1D	1W	YTD
국내 채권	한국 국고채 3년물	2.936%	0.4	-0.7
	한국 국고채 10년물	3.118%	0.1	-1.2
	장단기금리차(10년-3년bp)	18.2	18.5	18.7
	3년 국채 선물(KTB)	105.82	-2.0	-4.0
	10년 국채 선물(LKTB)	116.02	2.0	2.0
해외 채권	미국채 2년물	4.098%	-4.3	6.4
	미국채 10년물	4.255%	-2.8	4.7
	장단기금리차(10년-2년bp)	15.7	14.2	17.5
	독일국채 10년물	2.336%	5.1	2.0
	호주국채 10년물	4.449%	-3.2	1.6

일간 금리 등락 폭 & 커브



외국인 3년 국채선물(KTB) 수급



외국인 10년 국채선물(LKTB) 수급



국내 채권시장 동향

- 국내 채권시장 약세 마감.
- 전일 미국채 약세에도 저가매수세 유입되며 금리 하락. 약세를 되돌리는 흐름이 나타남. 다만 주요지표 부채 속 미 대선, FOMC 등 앞둔 부담은 시장을 압박
- 한은 총재 국감 발언은 매파적으로 평가됨. 총재, 환율 변동성에 대한 경계감 표출. 성장률은 잠재성장을 상회할 것으로, 전면적 부양은 불필요하다는 시각 강조. 금리는 오후 중 상승 전환함

전망 및 향후 주요 이벤트

- 미국 채권시장 강세 마감.
- 장 초반 미국채는 약세를 지속, 10년 금리는 장 중 4.3%를 상향 돌파. 다만 7년물 입찰이 견조한 수요 속 무난히 마무리되자 금리는 반락함
- 지정학 긴장 완화된 점도 일부 긍정적으로 작용. 이스라엘이 레바논 헤즈볼라와 휴전에 나설 것이라 기대가 주목됨. WTI는 최근 7주 중 최저치
- 지표는 혼조세로, 금리 영향은 미미. 구인건수는 21년 초 이후 최저치 기록, 예상을 대폭 하회함. 반면 CB 소비자신뢰지수는 예상 및 전월치 상회

자료 출처: 연합인포맥스, Refinitiv, 유진투자증권

본 자료는 참고용 자료일 뿐이고, 특정주식에 대한 투자목적으로 작성된 것이 아닙니다. 본 자료는 담당자가 신뢰할 수 있다고 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: %, \$)

	10/29일	1D	1W	YTD
원/달러	1,386.50	0.1%	0.5%	7.6%
달러지수	104.26	-0.0%	0.2%	2.9%
달러/유로	1.082	0.0%	0.2%	-2.1%
환율 위안/달러(역외)	7.14	-0.0%	0.1%	0.2%
엔/달러	153.36	0.0%	1.5%	8.9%
달러/파운드	1.302	0.3%	0.2%	2.3%
헤알/달러	5.76	0.9%	1.2%	18.7%
WTI 근월물(\$)	67.21	-0.3%	-6.8%	-6.2%
금 현물(\$)	2,774.94	1.2%	0.9%	34.5%
구리 3개월물(\$)	9,530.50	-0.1%	-0.5%	11.4%

원달러 환율 및 국제유가 동향



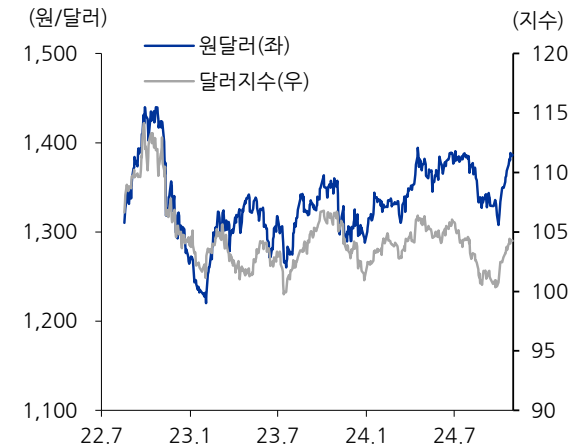
원달러 환율 및 위안달러 환율 동향



원달러 환율 동향

- 달러-원 환율은 서울 외환시장에서 +1.50원 상승한 1,386.50원에 마감. 야간거래에서는 1,382.20원 마감.
- 중동 지역의 불안이 잦아들고 간밤 달러도 소강상태를 보이면서 달러-원은 오전 중 낙폭을 확대. 장중 이창용 총재도 국정감사에서 환율 상승에 유의하고 있다고 발언.
- 그러나 오후 들어 중화권 증시와 위안화가 모두 약세로 돌아서면서 달러-원은 상승 반전.

원달러 환율 및 달러지수 동향



달러 지수 동향 및 관전 포인트

- 달러 인덱스는 견고한 미국 경제지표 속에 상승.
- 미국 9월 구인건수는 744만 건으로 시장 예상치를 50만건 가량 하회. 해고건수는 지난해 1월 이후 최고치 기록.
- 그러나 구인건수 악화는 소비자들의 심리 개선으로 상쇄. 10월 소비자 신뢰지수는 108.7로 전월비 9.5pt 급등하면서 지난해 8월 이후 최고치. 노동시장의 여건도 전월비 개선된 것으로 나타남.
- 금일 미국 및 유로존 3Q GDP 발표 예정.