

Eugene's FICC Update



유진투자증권

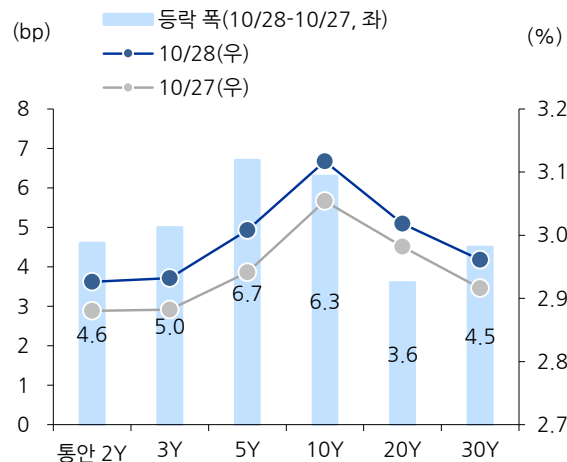
Fixed Income 김지나_02)368-6149_jnkim0526@eugenefn.com Economist 이정훈_02)368-6176_jhoonlee@eugenefn.com RA 유재혁_02)368-6177_dbwogur170@eugenefn.com

Fixed Income

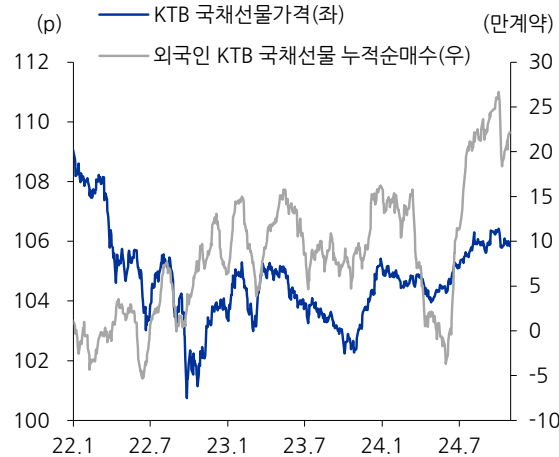
(단위: %,bp, 톱)

		10/28일	1D	1W	YTD
국내 채권	한국 국고채 3년물	2.932%	5.0	3.0	-22.2
	한국 국고채 10년물	3.117%	6.3	6.3	-6.6
	장단기금리차(10년-3년,bp)	18.5	17.2	15.2	2.9
	3년 국채 선물(KTB)	105.84	-16.0	-15.0	42
	10년 국채선물(LKTB)	116.00	-60.0	-66.0	50
해외 채권	미국채 2년물	4.141%	3.5	10.8	-10.9
	미국채 10년물	4.283%	4.2	8.7	40.4
	장단기금리차(10년-2년,bp)	14.2	13.5	16.4	-37.1
	독일국채 10년물	2.286%	-0.5	0.1	28.2
	호주국채 10년물	4.481%	6.9	20.6	52.6

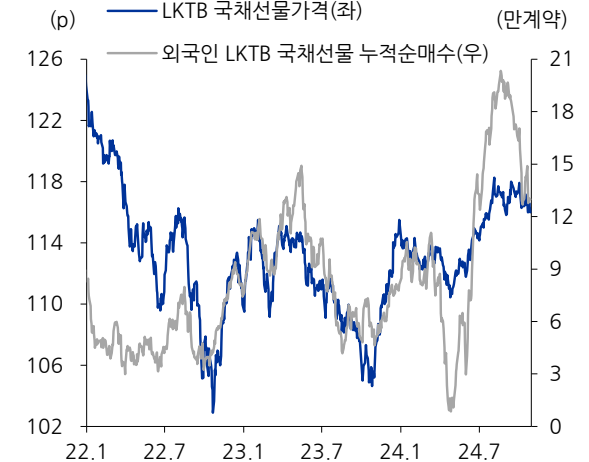
일간 금리 등락 폭 & 커브



외국인 3년 국채선물(KTB) 수급



외국인 10년 국채선물(LKTB) 수급



국내 채권시장 동향

- 국내 채권시장 약세 마감.
- 전일 미국채 약세, 한은 총재 매파 발언으로 금리 급등. 총재, 올해 성장률은 잠재성장률 2%보다 반드시 높을 것이며 환율은 정책 고려 요인에 재진입했음을 언급
- 아시아장 중 미국채 금리가 트럼프 트레이드 및 연준 인하 속도 조절 우려로 상승한 점도 약세 지지

전망 및 향후 주요 이벤트

- 미국 채권시장 약세 마감.
- 달러스 연은 10월 제조업 지수, 전월비 +6pt 오르며 30개월만에 최대치를 기록. 미국채 2·5년물 입찰 수요 부진도 미국채 금리 상승에 기여
- 이스라엘, 이란 핵·석유시설이 아닌 기타 부문 등에 제한된 대응을 보이며 지정학 긴장 완화. 국제 유가 5% 이상 급락하였으나 당일 금리 영향은 미미
- 금일 미국 8월 주택가격지수, 미국 10월 CB소비자신뢰 지수, 미국 JOLTs 보고서 등 발표 예정

자료 출처: 연합인포맥스, Refinitiv, 유진투자증권

본 자료는 참고용 자료일 뿐이고, 특정주식에 대한 투자목적으로 작성된 것이 아닙니다. 본 자료는 담당자가 신뢰할 만한다고 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

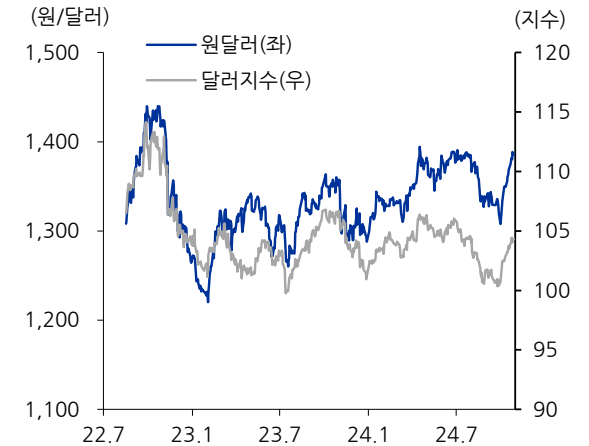
(단위: %, \$)

	10/28일	1D	1W	YTD
원/달러	1,385.00	-0.3%	0.7%	7.5%
달러지수	104.30	-0.0%	0.3%	2.9%
달러/유로	1.081	0.2%	-0.0%	-2.1%
환율 위안/달러(역외)	7.14	0.1%	0.1%	0.3%
엔/달러	153.29	0.7%	1.6%	8.8%
달러/파운드	1.297	0.1%	-0.1%	1.9%
헤알/달러	5.71	0.0%	0.3%	17.6%
상품 WTI 근월물(\$)	67.38	-6.1%	-4.5%	-6.0%
금 현물(\$)	2,742.43	-0.2%	0.8%	32.9%
구리 3개월물(\$)	9,556.00	-0.5%	-0.0%	11.6%

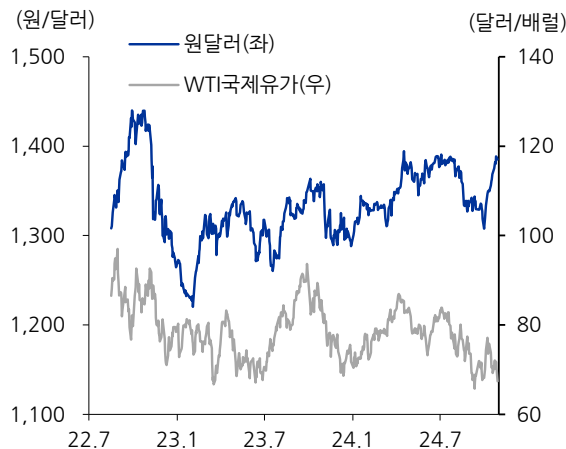
원달러 환율 및 위안달러 환율 동향



원달러 환율 및 달러지수 동향



원달러 환율 및 국제유가 동향



원달러 환율 동향

- 달러-원 환율은 서울 외환시장에서 -3.70원 하락한 1,385.00원에 마감. 야간거래에서는 1,385.70원 마감.
- 지난 주말 미국 지표 호조와 중동 불안 등에 달러-원은 1,390원 대에서 상승 출발. 그러나 이란이 즉각적인 보복을 시사하지 않으면서 위험 회피심리가 악화. 달러-원도 개장 직후 낙폭을 축소.
- 장중 이창용 한은 총재의 환율 상승을 우려하는 코멘트가 나왔고 달러-원은 오전 중 보험권에서 횡보하다 오후 들어 낙폭 확대. 국내증시가 강세폭을 키웠고 그간 원화 약세가 가파르게 진행되면서 차익실현 매물 출회.

달러 지수 동향 및 관전 포인트

- 달러 인덱스는 미국 대선 대기 심리 속 소강 상태를 보이며 하락.
- 간밤 특별한 이벤트는 없었음. 중동 불안 완화로 국제유가가 급락하면서 미국채 수익률과 달러 강세 모두 진정되었으나, 장후반 금리 반등과 함께 달러도 소폭 반등.
- 10월 달러스 연은 제조업지수는 -3으로 기준선은 하회했지만 전월비 6pt 상승.
- 금일 미국 구인이직보고서 및 소비자신뢰지수 발표 예정. 고용지표 둔화 흐름 이어갈지 주목.