Eugene's FICC Update

유진투자증권

Fixed Income 김지나_ 02)368-6149_ jnkim0526@eugenefn.com Economist 이정훈_ 02)368-6138_ jhoonlee@eugenefn.com

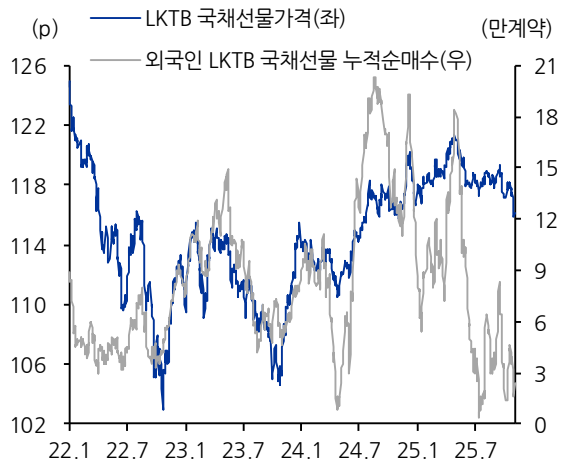
Fixed Income

(단위: %,bp, 틱)

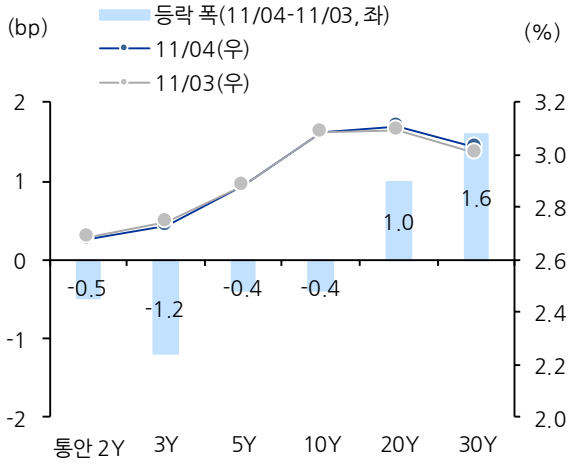
		11/4일	1D	1W	YTD
국내 채권	한국 국고채 3년물	2.729%	-1.2	9.6	13.3
	한국 국고채 10년물	3.082%	-0.4	14.7	22.7
	장단기금리차(10년-3년,bp)	35.3	34.5	30.2	25.9
	3년 국채 선물(KTB)	106.36	3.0	-31.0	-29.0
	10년 국채선물(LKTB)	116.08	15.0	-142.0	-84.0
해외 채권	미국채 2년물	3.577%	-2.9	8.6	-66.3
	미국채 10년물	4.086%	-2.5	10.9	-48.6
	장단기금리차(10년-2년,bp)	50.9	50.5	48.7	33.3
	독일국채 10년물	2.652%	-1.3	2.9	28.9
	호주국채 10년물	4.349%	1.2	17.5	-1.9

외국인 3년 국채선물(KTB) 수급

외국인 10년 국채선물(LKTB) 수급



일간 금리 등락 폭 & 커브



국내 채권시장 동향

- 국내 채권시장 소폭 강세 마감.
- 전일 미국채 약세 영향과 개장 전 10월 CPI 발표 후 금리 상승 출발. 국고 30년물 입찰 시행된 가운데 오전중 금리 상승폭 전구간에서 매우 거셌음.
- 이후 이재명 대통령의 예산안 관련 연설 이후 금리 상승폭 줄이기 시작. 예상보다 재정 확대에 대한 발언이 없었던 것의 영향. 또한 코스피 2%대 급락, 국내 기관의 숏커버 등으로 장 막판 금리 하락 전환.

전망 및 향후 주요 이벤트

- 미국 채권시장 소폭 강세 마감. 위험자산 선호 심리 잠시 주춤하며 금리 하락.
- 전일에 비해 회사채 발행량이 크게 줄어든 가운데(조달기업 전일 13개 -> 3개로 감소) 기술주 중심으로 뉴욕증시가 하락한 영향이 컸음.
- 특별한 경제지표 등 재료 없었으나 글로벌 IB의 CEO 등 주요 인사들이 향후 증시 조정 가능성에 대해 언급한 것에 대한 반응으로 보임.

자료 출처: 연합인포맥스, Refinitiv, 유진투자증권

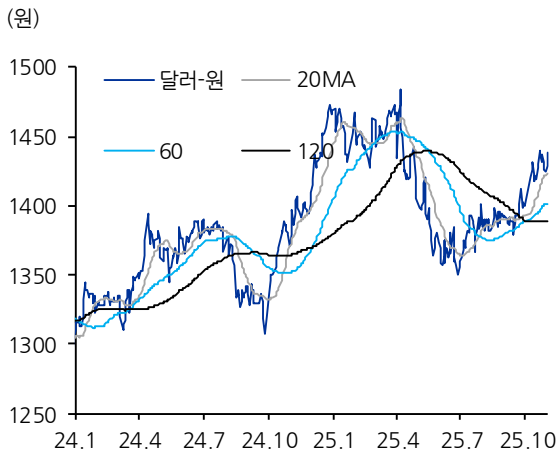
본 자료는 참고용 자료일 뿐이고, 특정주식에 대한 투자목적으로 작성된 것이 아닙니다. 본 자료는 담당자가 신뢰할 만하다고 판단하는 자료나 정보에 근거하여 작성되었지만, 그 정확성이나 완전성을 보장할 수는 없습니다. 따라서 본 자료를 참고한 고객의 투자의사 결정은 고객 자신의 판단과 책임아래 이루어져야 하고, 당사는 본 자료의 내용에 의존하여 행하여진 일체의 투자행위의 결과에 대하여 책임을 지지 않을 것임을 밝힙니다. 아울러 본 자료는 당사 고객에게만 제공되는 자료로서 당사의 동의 없이 본 자료를 무단으로 복제/전송/인용/배포하는 행위는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

FX & Commodity

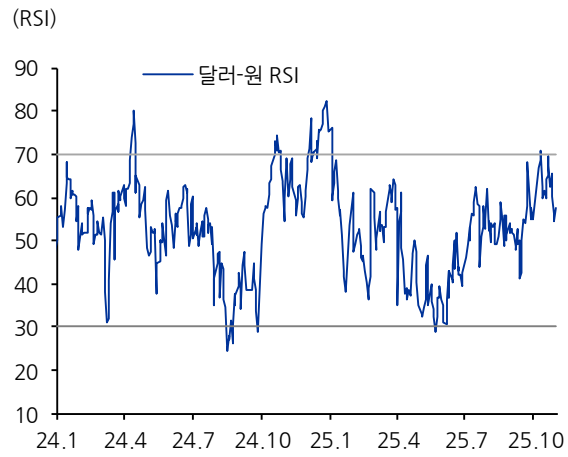
(단위: %, $)

		11/4일	1D	1W	YTD
환율	원/달러	1,437.90	0.6%	0.0%	-2.3%
	달러지수	100.22	0.3%	1.5%	-7.6%
	달러/유로	1.148	-0.3%	-1.5%	10.9%
	위안/달러(역외)	7.14	0.1%	0.6%	-2.7%
	엔/달러	153.63	-0.4%	1.0%	-2.2%
	달러/파운드	1.302	-0.9%	-1.9%	4.0%
	헤알/달러	5.40	0.8%	0.8%	-12.7%
상품	WTI 근월물($)	60.44	-1.0%	0.5%	-15.7%
	금 현물($)	3,938.79	-1.8%	-0.3%	50.1%
	비트코인($)	100,530.00	-6.1%	-11.6%	6.8%

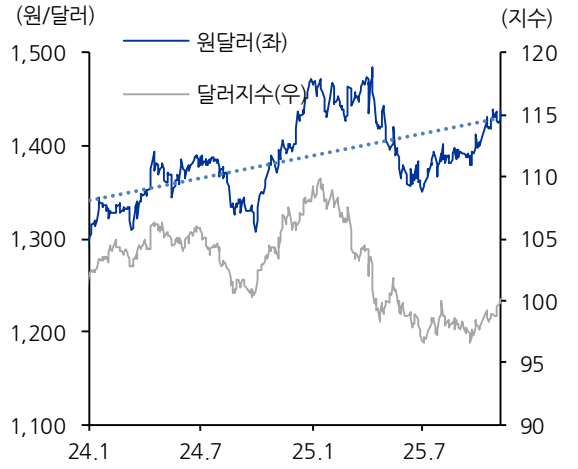
달러-원 환율 및 이동평균선



달러-원 환율 상대강도지수



달러-원 환율 및 달러인덱스 동향



원달러 환율 동향

- 달러-원은 서울 외환시장에서 +9.10원 상승한 1,437.90원에 마감. 야간거래에서는 1,440.60원 마감.
- 간밤 미국에서는 연준 인사들의 매파적 발언이 이어지며 달러 강세가 계속됨. 달러-원은 +1.70원 상승 출발 후 꾸준히 상승폭 확대.
- 이날 국내주식 시장이 코스피가 차익실현 장세 속 -2.3% 급락하는 도중 외국인들이 국내주식을 2조원 가량 대거 순매도하며 환율 상승 압력 받았음.

달러 지수 동향 및 관전 포인트

- 달러 인덱스는 미국 증시 급락 속 위험 회피 심리에 강세, 달러인덱스 100 돌파.
- 전일 한국장에 이어 미국 시장에서도 별다른 악재 출현 없이 증시 고평가 논란 속 위험 선호 심리가 크게 후퇴. 나스닥은 -2% 급락했고, 비트코인(-5%), 이더리움(-9%)등 암호화폐 시장도 급락.
- 달러 인덱스는 위험 선호 후퇴와 함께 파운드 약세 영향에 100선 탈환. 리브스 영국 재무자관이 연설 중 이달 말 발표할 예산안에서 긴축 기조를 가져가지 않을 것이라는 늬앙스를 풍기자 파운드화 약세.
- 금일 미국 ADP 고용 및 ISM 서비스업지수 발표 예정.