

뉴욕증시 - 中경제우려 & 중동 우려 & 北핵실험 & 유가하락 타격 ...다우 1.47% ↓

1. 中, 위안화 대폭 평가절하 고시...위안화 가치 0.22% 하락
2. 북한의 수소탄 핵실험 발표로 국제사회 분노
3. 중동의 지정학적 위기 고조 지속
4. 국제유가, 사우디&이란 대립으로 OPEC 감산 가능성 더욱 희박 ...5.6% 급락
5. 美 경제지표 혼조세
 - * 12월 ADP비농업고용변동 211K → 257K (예상:192K)
 - * 11월 무역수지 -44.58B → -42.37B (예상:-44.00B) ...수입, 약 5년래 최소
 - * 12월 서비스PMI 53.7 → 54.3 (예상:55.1)
 - * 12월 ISM비제조업PMI 55.9 → 55.3 (예상:56.0) ...2014년 4월 이후 최저
 - * 11월 공장주문 (MoM) 1.3% → -0.2% (예상:-0.2%)
6. 연준 위원들, 물가 상당한 우려 표명 <12월 의사록> ...경제 상황 '점진적 금리 인상'만을 지지
 - * 피셔 연준 부의장, FRB 예상 올해 금리인상 4회는 대략적 수치 <CNBC>
7. 中-12월 Caixin서비스PMI 51.2 → 50.2 (예상:52.3) ...예상 하회
8. 세계은행, 올해 세계경제 3.6% 성장 전망
9. 구리 가격, 中정부의 15만톤 국내 구리 구입 소식에도 0.36% 하락

국제 증시			국제 상품		
DOW30	16906.51	(-1.47%)	WTI	33.97	(-5.6%)
NASDAQ	4835.77	(-1.14%)	COMEX금	1091.90	(+1.3%)
S&P500	1990.26	(-1.31%)	COMEX구리	2.0880	(-0.36%)
KOSPI	1925.43	(-0.26%)	주요국가 10y국채		
KOSDAQ	687.27	(+0.47%)	한국	2.035%	(-2.2bp)
국제 통화			미국	2.177%	(-7.3bp)
유로/달러	1.0786	(+0.0036)	영국	1.79%	(-8.1bp)
유로/엔	127.79	(-0.16)	독일	0.50%	(-3.8bp)
달러/엔	118.47	(-0.55)	프랑스	0.87%	(-3.4bp)
달러/위안	6.5314	(+0.0145)	이탈리아	1.48%	(-1.8bp)
원/달러	1197.90	전일 1188.00	스페인	1.67%	(-1.7bp)
NDF	1201.00 / 1201.50원	2.20원 상승	그리스	8.17%	(0)

금일 예정 지표			
국가	경제지표	Previous	Forecast
[Chicago Fed President Evans Speaks]			
미국	-주간신규실업수당청구건수	287K	275K
	-12월 실업률	10.7%	10.7%
유로존	-12월 소매판매 (MoM)	-0.1%	0.2%
	-12월 소비자신뢰지수	-5.9	-6.0
독일	-11월 공장주문 (MoM)	1.8%	0.1%

1.전일 장중 동향

*KTB : 시가 109.69 / 증가 109.69

*LKT : 시가 126.46 / 증가 126.70

1)전일 미국채금리는 글로벌 증시가 안정되면서 소폭 약세를 보임. 10년물은 0.3bp 상승한 2.248%를 나타냄.
-채권시장은 오전에는 대체로 조용한 흐름. 3년 국채선물은 레벨 부담에 큰 변동이 없었고 10년 국채선물은 외인의 국채선물 매수에 소폭 강세.

-오전 11시경 북한에서 수소탄실험으로 인공지진이 발생했다는 소식이 들리며 채권시장이 반응하기 시작함.

-정부는 북한 수소탄실험에 따른 금융시장 변동성을 면밀히 모니터링하고 쓸림시 대처하겠다는 입장을 밝혔고 안전자산인 채권은 강세폭을 키워나감.

-오후에도 채권시장은 강세 흐름이 이어감. 특히 장기물은 외인의 국채선물 매수를 필두로 강세폭을 키움.

2)CRS 금리가 장기구간 위주로 하락. 북한의 핵실험 소식이 전해진 가운데 에셋스와프 물량이 장기구간에 몰리면서 커브 플래트닝 흐름이 강화됨.

-부채스와프가 나올 수 있는 상황이 아니어서 중국발 금융시장 불안이 해소되지 않는 한 CRS 반등이 어려운 분위기로 보임.

3)IRS 금리도 장기구간 위주로 하락. 10년 국채선물 강세에 연동됐으나 채권 현물시장보다는 상대적으로 약한 모습을 보임.

국내 주요 금리			BOND SWAP SPREAD		
3y	1.639%	(-0.4bp)	3y	-2.4bp	(+0.2bp)
5y	1.788%	(-0.4bp)	5y	-7.8bp	(-0.4bp)
10y	2.035%	(-2.2bp)	10y	-14.0bp	(+1.2bp)
CD	1.670%	(0)			

IRS OUTRIGHT			IRS SPREAD		
1Y	1.5900%	(0)	1*2Y	-0.75	(0)
2Y	1.5825%	(0)	2*3Y	3.25	(-0.25bp)
3Y	1.6150%	(-0.25bp)	2*5Y	12.75	(-0.75bp)
5Y	1.7100%	(-0.75bp)	3*5Y	9.50	(-0.5bp)
7Y	1.7900%	(-0.75bp)	5*7Y	8.00	(0)
10Y	1.8950%	(-1.0bp)	5*10Y	18.50	(-0.25bp)