

뉴욕증시 - 유가 30달러 붕괴에 급락 ...다우 1.80% ↓

1. 국제유가, 감산 기대감 사라져 또 30달러 붕괴 ...WTI 5.5% 급락
 - * OPEC 대부분 회원국 '산유량 감축' 긴급회의 반대 <WSJ>
 - * 에너지(-3.81%) & 원자재 업종(-2.51%) 하락세 주도
 - * 유럽증시도 유가 급락에 이틀째 ↓
2. 美 10y국채수익률, 유가 약세에 따른 유럽증시 약세로 9개월래 최저치 기록 ...금융주 하락
 - ...일낙폭 2015년 7월6일 이후 최대
3. 美 에스더 캔자스시티연은 총재, 시장 변동성 우려 안해 ...점진적 금리인상
4. 유로존-1월 실업률 10.5% → 10.4% (예상:10.5%) ...4년여래 최저
 - 12월 PPI (MoM) -0.2% → -0.8% (예상:-0.6%) ...예상 하회
5. 독일-1월 실업률 6.3% → 6.2% (예상:6.3%) ...예상 하회

국제 증시			국제 상품		
DOW30	16153.54	(-1.80%)	WTI	29.88	(-5.5%)
NASDAQ	4516.95	(-2.24%)	COMEX금	1127.20	(-0.1%)
S&P500	1903.03	(-1.87%)	COMEX구리	2.0550	(-0.02%)
KOSPI	1906.60	(-0.95%)	주요 국가 10y국채		
KOSDAQ	684.86	(-0.10%)	한국	1.916%	(-0.6bp)
국제 통화			미국	1.864%	(-10bp)
유로/달러	1.0913	(+0.0020)	영국	1.54%	(-7.8bp)
유로/엔	130.94	(-0.88)	독일	0.30%	(-4.4bp)
달러/엔	119.98	(-1.01)	프랑스	0.64%	(-3.1bp)
달러/위안	6.5510	(-0.0029)	이탈리아	1.48%	(+1.7bp)
원/달러	1207.40	전일 1200.50	스페인	1.58%	(+1.8bp)
NDF	1213.00 / 1213.50원	4.85원 상승	그리스	9.16%	(+9.8bp)

금일 예정 지표			
국가	경제지표	Previous	Forecast
[BoJ Governor Kuroda Speaks]			
미국	-1월 ADP비농업고용변동	257K	195K
	-1월 Markit종합PMI	53.7	
	-1월 서비스PMI	53.7	53.7
	-1월 ISM비제조업PMI	55.8	55.1
	-1월 ISM비제조업고용	56.3	
중국	-1월 Caixin서비스PMI	50.2	50.5
유로존	-1월 Markit종합PMI	53.5	53.5
	-1월 서비스PMI	53.6	53.6
	-12월 소매판매 (MoM)	-0.3%	0.3%
독일	-1월 종합PMI	54.5	
	-1월 서비스PMI	55.4	55.4
영국	-1월 서비스PMI	55.5	55.3

1.전일 장중 동향

*KTB : 시가 110.07 / 종가 110.08

*LKT : 시가 127.91 / 종가 127.95

1)글로벌 채권 금리가 올랐지만, 국내 물가상승률이 예상을 밑돌면서 특별한 방향성을 보이지 않음. 10년 만기 미국채 금리는 전날보다 2.68bp 상승한 1.9503%를 기록. 지난달 소비자물가 상승률은 0.8%를 나타냄.

-국고채 금리는 개장부터 외인의 KTB 매수세가 들어오면서 단기물을 중심으로 하락. 국고 30년물 입찰 전까지 약세이던 장기물 금리는 입찰에서 실수요가 일부 확인됐다는 인식에 강세로 전환.

-외인이 장중 현물채권을 매도했지만, 국채선물 매수세로 옮겨간다고 추측하면서 매수 심리가 유지됨. 국고 3년물 1.50%, 국고 10년물 1.90%에서 하단을 테스트하며 장을 마침. 국채선물은 장단기 구간에서 모두 상승.

2)CRS 금리가 구간별로 차별화된 흐름을 보임. 1년 이하 단기구간은 FX 스와프포인트 반등에 연동해 올랐지만, 나머지 중·장기구간은 오퍼가 우위를 보이며 하락.

-CRS 중기 이상 구간이 하락한 것은 지금 상황에서 딱히 나을만한 부채스와프 물량이 없어 오퍼 위주의 수급이 전개되고 있기 때문으로 보임.

3)IRS 금리는 채권시장 강세 속에 전 구간이 하락. 3년 구간 등 중기구간이 가장 많이 내렸고, 장기구간의 하락은 제한.

-외인이 3년 국채선물을 사면서 10년 선물을 판 것이 IRS 커브에도 영향을 줌. 여전히 IRS 전반적으로 롱 관성이 강해 비드가 나오면 곧바로 오퍼가 내려오면서 체결이 되고 있음.

국내 주요 금리			BOND SWAP SPREAD		
3y	1.516%	(-0.9bp)	3y	-4.1bp	(-0.4bp)
5y	1.640%	(-0.5bp)	5y	-9.5bp	(-0.3bp)
10y	1.916%	(-0.6bp)	10y	-20.4bp	(+0.1bp)
CD	1.650%	(0)			

IRS OUTRIGHT			IRS SPREAD		
1Y	1.4925%	(-0.25bp)	1*2Y	-3.00	(0)
2Y	1.4625%	(-0.25bp)	2*3Y	1.25	(-1.0bp)
3Y	1.4750%	(-1.25bp)	2*5Y	8.25	(-0.5bp)
5Y	1.5450%	(-0.75bp)	3*5Y	7.00	(+0.5bp)
7Y	1.6150%	(-0.75bp)	5*7Y	7.00	(0)
10Y	1.7125%	(-0.5bp)	5*10Y	16.75	(+0.25bp)