

뉴욕증시 - OPEC 감산 의향에 낙폭 줄여 ...다우 1.6% 하락 마감

1. 국제유가, 공급과잉 우려에 13년래 최저치 기록

...UAE 석유장관 "OPEC, 감산 준비됐다" ...장 막판 낙폭 다소 만회

2. 엘런 美 연준 의장 "마이너스 금리 검토 중 ...당장 실행 아니다"

* 연준, 다음 기준금리 인상 6월 유력 <WSJ 설문>

3. 美 고용시장 강세 지속

* 신규실업수당청구건수 285K → 269K (예상:281K) ...예상 하회

4. 유럽증시, 금융기관 부실화 우려에 2%대 급락

국제 증시			국제 상품		
DOW30	15660.18	(-1.60%)	WTI	26.21	(-4.5%)
NASDAQ	4266.84	(-0.39%)	COMEX금	1247.80	(+4.5%)
S&P500	1829.08	(-1.23%)	COMEX구리	2.0065	(-1.01%)
KOSPI	1861.54	(-2.93%)	주요 국가 10y국채		
KOSDAQ	647.69	(-4.93%)	한국	1.766%	(-11.6bp)
국제 통화			미국	1.664%	(-1.1bp)
유로/달러	1.1325	(+0.0033)	영국	1.30%	(-10.9bp)
유로/엔	127.22	(-0.75)	독일	0.18%	(-5.4bp)
달러/엔	112.32	(-0.98)	프랑스	0.59%	(-1.9bp)
달러/위안	6.5314	(0.0000)	이탈리아	1.71%	(+7.6bp)
원/달러	1202.50	전일 1197.40	스페인	1.77%	(+5.8bp)
NDF	1200.00 / 1201.00원	3.00원 하락	그리스	11.1%	(+45.8bp)

금일 예정 지표			
국가	경제지표	Previous	Forecast
[EU Finance Ministers Meeting]			
미국	-2월 미시간대소비자신뢰지수	92.0	92.0
	-1월 소매판매 (MoM)	-0.1%	0.1%
	-1월 수출물가지수 (MoM)	-1.1%	-0.9%
	-1월 수입물가지수 (MoM)	-1.2%	-1.4%
	-12월 기업재고 (MoM)	-0.2%	0.1%
유로존	-4분기 GDP (QoQ)	0.3%	0.3%
	-12월 산업생산 (MoM)	-0.7%	0.3%
독일	-4분기 GDP (QoQ)	0.3%	0.3%
	-1월 CPI (MoM)	-0.8%	-0.8%

1.전일 장중 동향

*KTB : 시가 110.37 / 종가 110.37

*LKT : 시가 129.29 / 종가 129.50

1)국고채 금리는 국고 3년 지표물 15-7호를 기준으로 전날보다 4.5bp 하락한 1.450%에 출발. 국고 10년 지

표물 15-8호는 전날보다 8.0bp 내린 1.800%에 시작.

-설 연휴 기간에 미국채 금리가 17bp 넘게 하락한 동향을 따라감. 엘런 Fed 의장이 다음달 FOMC에서 금리를 올리지 않을 수 있다는 전망이 확산한 점도 매수세를 부추김. 10년 만기 미국채 금리는 1.6707%를 기록해 설 연휴에 17.13bp 내려옴.

-국고채 금리는 코스피를 포함한 주요국 주가가 내려가면서 낙폭을 확대. 예상보다 금리 하락세가 가파르자 손절성 매수가 추가됨. 외인이 장중 국채선물을 매도했지만, 금통위가 금리를 인하할 수 있다는 예상이 퍼지면서 강세 분위기가 꺾이지 않음.

2)국채선물은 장단기 구간에서 모두 상승으로 마감. KTB와 LKTB의 장중 고점은 각각 110.41, 129.66을 기록. KTB의 미결제약정은 전날보다 4천49계약 증가.

3)IRS 금리가 글로벌 안전자산 선호 심리 등으로 큰 폭으로 하락. 5년 이상 장기구간은 10bp 넘게 급락하며 커브 플랫닝이 심화됨.

-IRS 금리는 장초반부터 국채선물이 폭등한 영향 등으로 하락압력을 받음. 단기구간은 2월 금통위에 대한 경계심리로 하락이 제한된 것으로 보임.

4)CRS 금리도 장기구간 위주로 큰 폭 하락. CRS 금리도 글로벌 안전자산 선호 심리가 반영됨. 채권자금을 포함한 외인들의 달러자금 유출에 대한 우려도 작용함.

-CRS 10년 구간이 1.01%에서 거래가 체결되며 커브가 크게 누움. 채권자금 유출에 대한 우려도 작용하는 것으로 보임.

국내 주요 금리			BOND SWAP SPREAD		
3y	1.450%	(-5.6bp)	3y	-5.0bp	(-1.2bp)
5y	1.539%	(-8.7bp)	5y	-11.9bp	(-2.1bp)
10y	1.766%	(-11.6bp)	10y	-21.6bp	(-1.4bp)
CD	1.640%	(-1.0bp)			

IRS OUTRIGHT			IRS SPREAD		
1Y	1.4450%	(-3.75bp)	1*2Y	-4.0	(-1.5bp)
2Y	1.4050%	(-5.25bp)	2*3Y	-0.5	(-1.5bp)
3Y	1.4000%	(-6.75bp)	2*5Y	1.5	(-5.5bp)
5Y	1.4200%	(-10.75bp)	3*5Y	2.00	(-4.0bp)
7Y	1.4750%	(-12.0bp)	5*7Y	5.50	(-1.25bp)
10Y	1.5500%	(-13.0bp)	5*10Y	13.00	(-2.25bp)