1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가격, 경기부양을 위한 통화완화에 나서던 세계 중앙은행들이 속도를 낼 필요가 줄고 있다는 우려에 하락

* 국채가격, 유럽장에서 이미 낮아진 데다 美 경제지표 발표 후 연내 기준금리 인상 기대가 다시 커지면서 가파르게 하락 출발

* 선진국 국채가, 아시아장에서부터 BOJ 총재가 "장기채 수익률 상승은 이상하지 않다"고 말한 데다 ECB의 양적완화(QE) 축소 우려가 지속해 일제히 하락

* 영국의 지난 3분기 GDP 호조도 국채가 하락 흐름을 강화
  - 유럽연합 탈퇴 결정 이후인 영국의 지난 3분기 GDP 예비치, 전분기보다 0.5% 증가...예상치 0.3% 증가를 웃돈 결과
    전년 동기대비로는 2.3% 증가해 역시 시장 예상치 2.1% 증가를 웃돔

* 국채가는 오후 들어 7년물 입찰에서 수요가 일정 부분 확인되면서 낙폭 소폭 만회
  - 美 재무부 $280억 어치의 7년만기 국채 연 1.653%에 발행 (지난 5월 이후 가장 높은 수준)
    응찰률은 2.49배를 보였으며 해외 중앙은행 등 간접입찰자들의 낙찰률은 61.5%로 올해 7월 이후 가장 높은 수준 (직접 입찰자들의 낙찰률은 13.2%로 5월 이후 최고점 기록)

[미국]

2y	0.80%	(+1.8bp)
5y	1.35%	(+4.7bp)
10y	1.85%	(+6.1bp)...지난 6월1일이후 최고치
30y	2.61%	(+7.3bp)

[기타 10Y물]

영국	1.25%	(+10.1bp)
독일	0.17%	(+8.5bp)
프랑스	0.45%	(+8.7bp)
이탈리아	1.53%	(+7.3bp)
스페인	1.19%	(+6.6bp)
그리스	8.21%	(+11.4bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 글로벌 국채 투매 현상과 부동산 업종 부진 영향으로 일제히 하락

* 대형 인수합병(M&A) 발표와 국제 유가 반등으로 상승 출발한 증시
  - 퀄컴, 네덜란드 반도체 기업 NXP를 470억 달러(약 53조7400억원)에 인수 계획
  - 사우디아라비아를 비롯한 OPEC 산유국들, 최대 생산량에서 4%까지 감산할 의지가 있는 것으로 알려졌으며 OPEC 산유국의 에너지 장관들이 이런 의향을 OPEC 비(非) 회원국인 러시아에 전달했다는 내용이 로이터통신에 보도되면서 감산 기대감 증폭

* 오후 들어 중앙은행이 양적완화를 지속할 것인지에 대한 의구심과 물가 하락에 대한 우려가 커지면서 국채 매도세가 나타남
  美 국채 장기물의 수익률이 강세를 보이면서 금리 상승에 영향을 받는 부동산업종 등에서 매도세가 강해짐

* <유럽 마감> 국제 유가 상승과 영국의 경제성장률이 기대를 웃돌았지만 엇갈린 기업 실적 영향으로 혼조세
  - 영국 에너지 기업인 에이멕 포스터 휠러, 실적 부진 여파로 20.4% 급락 / 노키아도 3분기 연속 적자를 기록하면서 7.6% 하락
  - ST마이크로일렉트로닉스는 실적 전망을 상향 조정하면서 10.4% 상승

* <상하이 마감> 9월 공업이익 지표 부진에 하락 마감
  - 9월 공업이익, 전년 대비 7.7% 증가... 전월의 19.5%에서 상승폭이 크게 둔화

* <도쿄 마감> 기업 실적에 대한 우려와 최근 국제유가 약세 여파로 하락
  - 닌텐도와 캐논이 부진한 실적을 보이며 하락 출발한 증시는 국제 유가 하락, 일본은행의 경기부양 가능성 후퇴 시사에 동력을 상실한 모습

DOW30	18169.68	(-0.16%)
NASDAQ	5215.97	(-0.65%)
S&P500	2133.04	(-0.30%)
NIKKEI225	17336.42	(-0.32%)
SHANGHAI	3112.35	(-0.13%)
FTSE100	6986.57	(+0.41%)
DAX30	10717.08	(+0.07%)
CAC40	4533.57	(-0.02%)

3.글로벌 환시

* 연방준비제도(Fed·연준)의 연내 기준금리 인상 가능성이 고공행진을 하면서 상승

유로/달러	1.0895	(-0.0012)
유로/엔	114.69	(+0.75)

달러/엔 105.27 (+0.81)
달러/위안 6.7736 (+0.0031)
파운드/달러 1.2162 (-0.00836)
NDF 1147.00 / 1148.00원...4.80원 상승

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 주요 산유국들의 생산량 제한과 관련한 합의 기대가 다시 살아난 데 따라 지난 3거래일 하락세를 딛고 상승 전환

* <국제 금값> 미국 경제지표가 올해 기준금리 인상을 지지할 정도로 호조를 보이지 않았다는 분석에 상승

WTI 49.72 (+1.1%)
COMEX금 1269.50 (+0.2%)

5. 전일 국내 지표

코스피 2024.12 (+0.51%)
코스닥 648.57 (+2.06%)
원/달러 1142.50 (+8.50)
KTB 110.39 (+0.02)
LKTB 130.46 (-0.19)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리, 장중 변동성 끝에 혼조세. 단기물은 상대적으로 강세였던 반면 장기물은 약세폭이 커지면서 커브 스티프닝.
- 한은이 최근 단기금리 상승을 예의주시하고 있다고 밝히면서 유동성 공급 기대감 상승 & 은행이 3년 국채선물 매수로 단기금리 강세를 이끌다 전일 대비 보합 수준에서 마감
- 반면 장기물은 약세 폭을 줄이기도 했지만 전일대비 강세로 전환되지는 못함. 외인이 10년 국채선물을 순매도하면서 약세 주도

CD(91d) 1.3900% (0.00bp)
1y 1.4100% (-0.40bp)
3y 1.4180% (+1.30bp)

5y 1.4790% (+2.50bp)
10y 1.6690% (+3.60bp)
20y 1.7160% (+2.80bp)
30y 1.7230% (+3.30bp)
50y 1.7140% (+3.10bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1Y -5.35bp (-1.75bp)
2Y -7.45bp (-2.60bp)
3Y -4.55bp (-2.30bp)
5Y -6.40bp (-2.00bp)
10Y -16.40bp (-2.10bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS 금리 혼조세. 커브 스티프닝. 최근 국고채 단기금리 분위기에 따라 변동성이 큰 분위기.
* CRS, 금리가 달러-원 환율 상승에 하락해 마감

*IRS 금리

1Y 1.3775% (-1.75bp)
2Y 1.3625% (-1.50bp)
3Y 1.3725% (-1.00bp)
5Y 1.4150% (+0.50bp)
7Y 1.4450% (+1.25bp)
10Y 1.5050% (+1.50bp)

1*2Y -1.50 (+0.25bp)
2*3Y 1.00 (+0.50bp)
2*5Y 5.25 (+2.00bp)
3*5Y 4.25 (+1.50bp)
5*7Y 3.00 (+0.75bp)
5*10Y 9.00 (+1.00bp)

*CRS 금리

1Y 1.1100% (-1.50bp)
2Y 1.0050% (-1.00bp)
3Y 0.9600% (-1.00bp)
5Y 0.9200% (-1.00bp)
7Y 0.8600% (-1.00bp)
10Y 0.8450% (-1.00bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* 혼조적인 美 경제지표
- 주간 실업보험청구자수는 감소해 노동시장이 여전히 견조한 상황임을 나타냄 (전주보다 3천명 감소한 25만8천명)
- 9월 내구재 수주실적 전월 대비 0.1% 감소...전월과 동일한 수준일 거라고 예상한 블룸버그 조사치를 밑도는 수준
- 9월 펜딩 주택판매지수, 1.5% 상승한 110.0 기록...조사치 1.0% 상회

* 오전 장중 홍콩 역외시장에서 달러-위안, 6.79위안 돌파... 2010년 위안화가 역외에서 거래를 시작한 이후 최저치

* BOJ 구로다 '현재는 장기금리 목표를 바꿀 계획이 없다'고 밝혀
- 다음 주 31일부터 이틀간 진행될 금융정책결정회의에서 물가상승률 전망 하향 조정외에는 시장을 놀래킬 만한 정책 결정은 없을 것이라는 분석

* BOJ 부총재, 양과 금리 측면의 강력한 완화 정책을 지속할 것이라 밝혀
- 현재의 금융정책 틀 아래 대규모 국채 매입을 지속할 것이며, 다만 연 80조엔 수준의 본원통화 확대 속도는 현재 적절하다고 언급

* 도이체 방크, 소송 충당금 더 쌓았음에도 불구하고 흑자전환 성공
- 지난 3분기 순이익 2억7800만유로 기록... 전문가들, 6억1천만유로 적자 예상
- 은행의 수익도 75억유로를 나타내 월가 추정치 72억유로보다 양호
- 존 크라이언 CEO '회사의 구조개혁이 원활하게 이뤄지고 있으며 가능한 한 빨리 해법을 찾기 위해 노력하고 있다'고 전함

[국내]

* 금리 상승 주시한다는 한은...어떤 액션 취할까
- 한은이 예정된 RP 매각을 통해 지급준비금 상황을 개선하거나 연내 RP 담보채권 직매입에 나설 가

능성이 클 것

* 국고·통안채 금리 역전현상...언제까지 지속될까
- 지난 25일 부가세 납부가 마무리됐고, 이날 국고여유자금 8조원과 재정방출 5조5천억원이 나오면서 최근의 부진은 다소 수그러든 모습
- 국고채와 통안채 금리역전 현상은 당분간 지속될 것으로 전망
- 금리역전 현상은 11월 9일인 지준 마감일과 11월 말이 지나서 다소 정상화될 것으로 예측

* 높아진 국고채 3년물 금리...매수 타이밍 '간보기'
- 금리 메리트 부각하면서 적절한 매수 타이밍 VS 단기자금시장 악화와 글로벌 채권 약세 분위기로 좀 더 지켜봐야

* 최상목 기재차관 "정치불안, 경제 펀더멘털과는 무관"

* 유일호 "올해 3% 가까운 성장...그나마 선방"

금일 예정 지표

[러시아 기준금리 결정]

미국-3분기 GDP(QoQ) (예상:2.5%, 이전:1.4%)
    -10월 미시간대 소비자심리지수 (예상:88.1, 이전:87.9)
    -3분기 고용비용지수 (예상:0.6%, 이전:0.6%)
일본-10월 근원 CPI(YoY) (예상:-0.5%, 이전:-0.5%)
    -9월 실업률 (예상:3.1%, 이전:3.1%)
독일-10월 CPI(MoM) (예상:0.1%, 이전:0.1%)