

1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가격은 도널드 트럼프 공화당 대통령 당선인이 재정정책 확대를 통해 물가 상승 압력을 높일 것이라는 우려로 가파르게 하락

* 국채가격, 전일 선거 결과로 공화당이 상하원을 모두 장악하면서 트럼프 당선인이 재정정책을 확대할 것이라는 전망으로 장기물 위주로 하락 출발

- 재정정책 확대는 총수요를 높여서 물가 압력을 높이는 데다 대규모 국채 발행 가능성을 높여 채권 시장에 큰 부담으로 작용

* 뉴욕증시가 하락 출발했다가 반등하고, 멕시코페소화도 낙폭을 줄이는 등 안정을 찾는 모습에 국채가 낙폭 확대에 가속도

* 오후 들어 10년물 입찰에서 약한 수요가 확인되면서 국채가 추가 하락

- 美 재무부 230억달러 어치의 10년 만기 국채를 연 2.020%에 발행... 입찰 수요 강도를 측정하는 응찰률은 2.22배를 보여, 2009년 3월 이후 최악이었으며 최근 평균 2.56배 하회

[미국]

2y 0.90% (+4.8bp)

5y 1.48% (+15.4bp)

10y 2.07% (+21.2bp)...2013년 7월5일 이후 최대 상승폭

30y 2.86% (+23.9bp)...2011년 8월11일 이후 최대 상승폭

[기타 10Y물]

영국 1.25% (+2.0bp)

독일 0.20% (+1.5bp)

프랑스 0.53% (+4.0bp)

이탈리아 1.75% (+3.1bp)

스페인 1.27% (+2.2bp)

그리스 7.21% (+10.3bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 도널드 트럼프 공화당 후보의 대통령 당선 충격에서 벗어나며 일제히 상승... 트럼프 정부에서 수혜가 예상되는 금융과 헬스케어, 산업 업종이 지수 상승을 이끌

* 트럼프의 승리연설이 포용적으로 나온 데다 경기부양책의 중심이 통화에서 재정으로 이동할 것이라는 점이 주목받으면서 시장 분위기 전환

- '모든 미국인을 위한 대통령이 되겠다' '적대감이 아닌 공통점을, 갈등이 아닌 파트너십을 찾아가겠다' '미국을 우선하겠지만 모든 국가를 공정하게 대하겠다'는 등 예상보다 급진적이지 않은 연설이 투

심 안정에 도움

- '도시를 고치고, 고속도로, 다리, 터널, 공항, 학교, 병원 등을 재건설하겠다'는 대규모 인프라 투자 의지 밝힘

* 9월 美 도매재고 0.1% 증가하였으나 예상치(+0.2%) 하회

- GDP 산출에 포함되는 자동차를 제외한 9월 도매재고는 0.4% 상승

* <유럽 마감> 헬스케어 업종 강세에 힘입어 장 초반 급락세에서 벗어나며 1% 넘게 상승

- 트럼프의 승리로 클린턴 후보가 내세웠던 약값 인하에 대한 두려움이 완화되면서 헬스케어 업종 4.6% 급등

* <상하이 마감> 도널드 트럼프 미국 공화당 대선 후보의 대통령 당선 우려에 하락하였으나 중국 증시의 개방성이 다른 증시에 비해 작아 하락폭은 제한적

* <도쿄 마감> 도널드 트럼프 미국 공화당 대선 후보가 선거에서 승리할 조짐을 보인 여파로 폭락

- 트럼프 후보의 당선이 유력해진 데 따라 촉발된 공포감에 안전 통화인 엔화는 급등...증시에 하방 압력

DOW30	18589.69	(+1.40%)
NASDAQ	5251.07	(+1.11%)
S&P500	2163.26	(+1.11%)
NIKKEI225	16251.54	(-5.36%)
SHANGHAI	3128.37	(-0.62%)
FTSE100	6911.84	(+1.00%)
DAX30	10616.01	(+1.56%)
CAC40	4543.48	(+1.49%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 도널드 트럼프 공화당 대통령 당선인의 포용적 연설과 재정확대 정책 가능성에 따른 경제적 효과 기대로 뉴욕증시가 상승해 따라 상승

- 멕시코 페소화, 트럼프 당선에 앞으로 경제 부담이 커질 것이라는 우려로 한때 20.78페소까지 달러화에 11% 급락

유로/달러	1.0909	(-0.0105)
유로/엔	115.51	(-0.26)
달러/엔	105.88	(+0.78)
달러/위안	6.7832	(+0.0015)
파운드/달러	1.24214	(+0.00522)
NDF	1158.00 / 1159.00원...8.75원 상승	

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 도널드 트럼프의 대선 승리에 대한 금융시장 충격이 완화한 데 따라 상승

* <국제 금값> 도널드 트럼프의 미국 대선 승리에 대한 시장의 우려가 다소 완화된 데 따라 소폭 하락

WTI 45.18 (+0.6%)

COMEX금 1273.50 (-0.1%)

5. 전일 국내 지표

코스피 1958.38 (- 2.25%)

코스닥 599.74 (- 3.92%)

원/달러 1149.50 (+14.50)

KTB 110.50 (+ 0.15)

LKTB 130.60 (+ 0.60)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리, 변동성 끝에 하락 마감. 도널드 트럼프 공화당 후보의 당선 가능성이 높아지면서 안전 자산으로의 쏠림현상이 나타남.

CD(91d) 1.3900% (0.00bp)

1y 1.3980% (-2.10bp)

3y 1.4020% (-2.30bp)

5y 1.4930% (-2.10bp)

10y 1.6710% (-3.10bp)

20y 1.7680% (-3.00bp)

30y 1.7890% (-3.20bp)

50y 1.7810% (-3.10bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1Y -8.30bp (-0.40bp)

2Y -11.10bp (-1.15bp)

3Y	-10.20bp	(-1.20bp)
5Y	-14.55bp	(-2.90bp)
10Y	-20.60bp	(-2.40bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 국채선물 강세로 금리 대폭 하락 마감. 장 중 100틱 이상 급등 하는 등 변동성이 큰 분위기

* CRS 금리, 달러-원 환율 급등으로 크게 하락해 마감. 미국 대선의 영향으로 최근 들어 가장 큰 변동 폭을 보임.

*IRS 금리

1Y	1.3250%	(-2.00bp)
2Y	1.3000%	(-2.75bp)
3Y	1.3000%	(-3.50bp)
5Y	1.3475%	(-5.00bp)
7Y	1.3950%	(-5.50bp)
10Y	1.4650%	(-5.50bp)

1*2Y	-2.50	(-0.75bp)
2*3Y	0.00	(-0.75bp)
2*5Y	4.75	(-2.25bp)
3*5Y	4.75	(-1.50bp)
5*7Y	4.75	(-0.50bp)
5*10Y	11.75	(-0.50bp)

*CRS 금리

1Y	0.9550%	(-7.50bp)
2Y	0.8850%	(-6.50bp)
3Y	0.8550%	(-7.50bp)
5Y	0.8350%	(-8.50bp)
7Y	0.8050%	(-9.00bp)
10Y	0.8100%	(-9.00bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* 중국 10월 생산자 물가지수(PPI), 작년 동월대비 1.2% 상승...2011년 12월 이래 4년 10개월 만에 최대 상승폭

- 석탄채굴, 철금속과 비철금속의 제련·가공, 석유가공 등 중공업 분야의 물가가 올라 PPI 상승 견인
- 10월 CPI,전년동기 예상치 부합하는 +2.1% 기록... 전월치 +1.9%보다 상승폭 확대

* 일본 9월 경상수지 흑자 27개월째 흑자 기록

- 1조8천210억엔(약 19조5천648억원) 잠정 집계...시장 예상치(2조200억엔) 하회한 수치지만 2014년 7월부터 27개월 연속 흑자 행진

* 역외에서 거래되는 달러-위안, 사상 처음으로 6.80위안 돌파...2010년 위안화가 위안화가 역외에서 거래를 시작한 이후 최저치 경신

- 美 대선에서 클린턴 민주당 후보가 승리하고 다음달 FOMC서 기준금리를 인상할 것이라는 우려감이 원인

* 뉴질랜드중앙은행, 기준금리 1.75%로 25BP 인하...뉴질랜드 역사상 최저 수준

- 이번 금리 인하로 물가가 상승할 것으로 보이며 금리 인하는 성장과 소비자물가지수(CPI)를 지지할 것이라고 예상

[국내]

* 임종룡 "금융시장 변동성 불가피...최상의 긴장감 가질 것"

* 이주열 "美대선결과는 가격조정 과정...변동성 과도 가능성"

* 유일호 "트럼프 당선으로 글로벌 금융시장 충격 불가피"

- 유일호 "브렉시트처럼 충격 클 것...영향 최소화 노력"
- 유일호 "미 대선 결과 부정적 영향 최소화 노력 다할 것"
- 유일호 "보호무역주의, 환율 압박 강화 등 불확실성 예상"

* 10월 금융채 발행액 1.5조 증가...카드채 금리메리트 부각

* 채권전문가 99%, 11월 기준금리 동결 예상

* 보험사, IFRS 급한 불 끄나...장기물 수요 다시 늘까

- 국제회계기준위원회(IASB)에 유예 요청을 한 국가가 많지 않아 IFRS4 2단계 도입이 미뤄지지 않을 수 있다는 전망이 나오면서 장기물 수급 상황에도 변화가 있을지 주목

* 韓 선박수주 작년의 15%...수주잔량 13년래 최저

****금일 예정 지표****

[존 윌리엄스 샌프란시스코 연은 총재 연설]

[제임스 블라드 세인트루이스 연은 총재 연설]

[필리핀 기준금리 결정]

미국-신규실업보험 청구자수 (예상:260K, 이전:265K)