

1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가격, 지난 2주간 도널드 트럼프 대통령 당선인의 재정정책 확대와 물가 기대 상승 우려로 급락한 후에 숨 고르기 장세에 들어가 보험권에서 혼조세를 보임

* 국채가격, 스탠리 피셔 연준 부의장이 정부의 정책에 대해 긍정적으로 평가했음에도 유럽장에서 높아진 기름폭 유지

- 지난 2주간 15년래 가장 큰 2주간 수익률 급등을 기록한 피로가 지속한 데다 시카고 연방준비은행의 전미활동지수(NAI)에서 물가 상승 압력이 약한 것으로 확인된 영향으로 풀이

* 국채가는 오후 들어 2년물 입찰에서 강한 수요가 확인되지 않은 데다 유가 강세로 에너지 주도의 뉴욕증시 강세가 지속해 기름폭을 줄임

- 美 재무부 \$260억 어치의 2년만기 국채를 연 1.085%에 발행...시장 예상치 정도 수준이지만 2009년 이후 가장 높은 낙찰금리

- 응찰률은 2.73배로 8월 이후 가장 높았지만 해외 중앙은행 등 간접입찰자들의 낙찰률은 35.8%로 최근 평균 40.5%에 못 미침

[미국]

2y 1.07% (+0.0bp)

5y 1.77% (-3.0bp)

10y 2.32% (-3.9bp)

30y 3.00% (-3.8bp)

[기타 10Y물]

영국 1.42% (-2.8bp)

독일 0.27% (+0.2bp)

프랑스 0.75% (-0.2bp)

이탈리아 2.07% (-2.2bp)

스페인 1.60% (+1.6bp)

그리스 6.79% (-13.4bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 국제 유가 급등과 기술 업종 강세에 힘입어 일제히 사상 최고치를 기록

* 중소형주 중심의 러셀2000도 역대 최고치로 마감... 4대 지수가 동시에 최고치를 기록한 것은 1999년 12월 이후 처음

* 유가가 4%가량 급등하며 에너지업종이 2.2% 상승하며 가장 큰 상승폭을 기록...기술과 소재, 유틸리티가 각각 1% 이상 올랐고 소비와 금융, 헬스케어, 산업 등이 강세를 보이는 등 부동산을 제외한 전업종 상승

* 국제 유가, 석유수출기구(OPEC)의 감산 합의 기대와 달러 약세 영향으로 4% 가까이 급등하면서 3주 최고

수준

- 블라디미르 푸틴 러시아 대통령, 산유량 감축 문제에 대해 '합의가 이루어질지 100% 장담할 수 없지만 성사될 가능성이 매우 높다' 언급

* <유럽 마감> 정치적 호재 & 유가 급등에 상승 마감

- 獨 메르켈 총리 내년 총선거서 총리직 4연임에 도전 선언 & 프랑스 제1야당 공화당 대선후보 경선 1차 투표에서는 예상을 뒤엎고 프랑수아 피용 전 총리가 1위로 2차 결선 투표에 진출한것이 호재로 작용

* <상하이 마감> 중국 당국의 위안화 절하로 위안화 가치가 떨어지면서 수출주의 실적 개선 전망이 증시를 끌어올림 ... 안방보험이 중국건축(601668.SH)에 5% 지분을 보유한 사실이 알려지면서 보험사들이 주식 투자를 확대할 것이라는 기대가 커진것도 호재로 작용

* <도쿄 마감> 엔화 약세와 경제 지표 호조에 상승 마감

DOW30	18956.69	(+0.47%)
NASDAQ	5368.86	(+0.89%)
S&P500	2198.18	(+0.75%)
NIKKEI225	18106.02	(+0.77%)
SHANGHAI	3218.15	(+0.79%)
FTSE100	6777.96	(+0.03%)
DAX30	10685.13	(+0.19%)
CAC40	4529.58	(+0.56%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 지난 2주간 도널드 트럼프 대통령 당선인의 재정정책 확대와 물가 기대 상승 우려로 급등한 후에 보험권에서 숨 고르기 혼조

위안화 절하, 2005년 7월 인민은행이 관리변동 환율제로 이행한 후 최장인 12거래일 연속으로 그간 2.2%나 절하됨

유로/달러	1.0625	(+0.0033)
유로/엔	117.98	(+0.60)
달러/엔	111.04	(+0.22)
달러/위안	6.8985	(+0.0189)
파운드/달러	1.2492	(+0.0140)
NDF	1178.00 / 1179.00원...8.30원 하락	

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 블라디미르 푸틴 러시아 대통령이 감산 지지발언을 내놓는 등 산유량 감축에 대한 기대가 커진 데 따라 상승

* <국제 금값> 달러화가 약세를 나타낸 데 따라 상승

WTI 47.49 (+3.9%)

COMEX금 1209.80 (+0.1%)

5. 전일 국내 지표

코스피 1966.05 (-0.43%)

코스닥 609.33 (-1.76%)

원/달러 1186.60 (+0.34)

KTB 109.32 (-0.04)

LKTB 125.57 (-0.01)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리, 한은의 단순매입 결과를 대기하면서 약세 흐름을 이어가다, 결과 발표 이후 약세폭을 일부 반납하며 혼조세로 마감.

- 한은 국고채 단순매입 1.27조 낙찰...응찰 1.97조

CD(91d) 1.4100% (+0.01bp)

[국고채]

1y 1.6090% (+1.90bp)

3y 1.7350% (-0.60bp)

5y 1.8800% (-0.10bp)

10y 2.1300% (-0.60bp)

20y 2.2250% (+0.50bp)

30y 2.2450% (+1.00bp)

50y 2.2320% (+1.00bp)

[통안채]

1y 1.6070% (+2.00bp)

2y 1.7300% (+1.50bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1Y -16.70bp (-2.50bp)

2Y	-23.75bp (-2.75bp)
3Y	-18.50bp (-0.15bp)
5Y	-22.25bp (-0.40bp)
10Y	-28.75bp (+0.10bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 장중 강·약세를 반복하다 보험권에 머무른 국채선물로 소폭 하락 마감. 지난주와 비교하면 비교적 조용했던 편.

* CRS, 전반적으로 금리 소폭 하락.

*IRS 금리

1Y	1.4400% (-0.50bp)
2Y	1.4925% (-1.25bp)
3Y	1.5500% (-0.75bp)
5Y	1.6575% (-0.50bp)
7Y	1.7375% (-0.50bp)
10Y	1.8425% (-0.50bp)

1*2Y	5.25 (-0.75bp)
2*3Y	5.75 (+0.50bp)
2*5Y	16.50 (+0.75bp)
3*5Y	10.75 (+0.25bp)
5*7Y	8.00 (+0.00bp)
5*10Y	18.50 (0.00bp)

*CRS 금리

1Y	0.9300% (-0.50bp)
2Y	0.9050% (-1.50bp)
3Y	0.9400% (-0.50bp)
5Y	0.9800% (-0.50bp)
7Y	1.0050% (-0.50bp)
10Y	1.0200% (-0.50bp)

9. 주요뉴스

[해외]

- * 美 연준 피셔 부의장, '미국 경제가 낮은 생산성 성장으로 심각한 장기적인 어려움에 직면'
 - '생산성을 증가시키는 특정 재정정책은 경제 잠재력을 향상하고 일부 장기적인 경제 어려움에 맞서는 것을 도와준다' 진단
 - 사회기반시설 확충과 감세 등 재정정책으로 경제정책의 중심을 옮기려는 도널드 트럼프 미국 대통령 당선인의 공약이 통화정책이 주로 담당해오던 경기부양에 도움이 될 것이라는 진단으로 풀이

- * 마리오 Дра기 ECB 총재 '경기 회복세가 탄탄하지만 물가를 목표 수준으로 올리는 데는 여전히 대규모의 통화완화 정책 필요'
 - 잠재성장률과 격차가 지속해서 좁혀짐에도 물가가 목표 수준으로 올라가는 것은 유달리 대규모로 시행되는 현재의 통화정책에 계속 의존하고 있기 때문이라고 설명

- * 10월 시카고 전미활동지수, 전월 -0.23에서 -0.08로 상승했으나 지수가 0을 밑돌아 경제가 역사적 추세를 하회하는 성장을 보이고 있음을 나타냄
 - 3개월 이동평균 전미활동지수는 전월의 -0.20에서 -0.27로 하락

- * 일본 10월 수출, 5조8천699억엔(약 62조4천300억원)으로 전년동기대비 10.3% 감소...13개월 연속 감소세
 - 10월 수출 감소 폭, 전월(-6.9%)보다 확대돼 지난 7월(-14.0%) 이후 3개월 만에 최대 낙폭
 - 10월 수입은 5조3천737억엔으로 전년대비 16.5% 감소하며 22개월째 내리막

[국내]

- * 국고 20년 0.462조 2.235%(+3.4bp) 낙찰...응찰 1.84조
- * 자본확충에 금리변수 더해지는 내년 보험시장
- * IFRS17 도입에 금융당국도 보험감독기준 개편 본격화

금일 예정 지표

[미·중 통상교역 공동위원회 회의 2일차]

- 미국-10월 기존주택판매 (예상:5.42M, 이전:5.47M)
 - 10월 기존주택판매(MoM) (예상:-0.9%, 이전:3.2%)
 - 11월 리치먼드 연은 제조업지수 (예상:1, 이전:-4)