

1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가격, 뉴욕증시 사상 최고치 행진에도 숨 고르기 장세가 이어져 혼조세

* 국채가격, 지난 2주간 도널드 트럼프 당선인의 재정투자 확대 기대로 급락한 후 전일부터 나타난 숨 고르기 장세로 상승 출발했지만 12월 기준금리 인상 기대가 100%선을 돌파하고 뉴욕증시가 다시 사상 최고치로 출발하면서 오름폭 축소

- FF 금리선물시장 연준의 12월 25bp 금리 인상 가능성을 한때 100.2% 까지 반영 <CME 페드워치>

* 일본 지진에 따른 안전자산 매수도 등장했지만 피해가 작아 크지는 않았음

* 미국 지난 10월 기준 주택판매 약 10년만에 최고치 소식에 국채가격이 오름폭 축소 시도에 나섰지만, 저점매수에 막힘

* 국채가, 오후 들어 뉴욕증시 강세 행진에다 전일에 이어 다시 국채 입찰에서 강한 수요가 확인되지 않자 오름폭 축소에 나섰으나 이번에도 저점매수에 돌아섬

* 최근 진행된 수익률곡선 스티프닝에 대한 베팅을 되돌리는 거래로 인해 단기물을 매도하면서 장기물을 사들이는 거래가 많아지면서 10년과 2년물 국채수익률 격차 줄어들음

[미국]

2y 1.09% (+1.4bp)

5y 1.77% (+0.4bp)

10y 2.31% (-0.7bp)

30y 3.00% (+0.5bp)

[기타 10Y물]

영국 1.36% (-6.4bp)

독일 0.22% (-5.4bp)

프랑스 0.70% (-5.1bp)

이탈리아 2.02% (-4.8bp)

스페인 1.52% (-8.4bp)

그리스 6.78% (-1.5bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 뉴욕 증시, 이틀째 사상 최고치 행진...달러 강세와 국제 유가 혼조에도 통신과 부동산 업종이 상승세를 이끔

* 기존주택 판매가 약 10년 만에 최고치를 기록하면서 상승 출발... 장 초반 나타난 국제 유가 상승세도 호재로 작용

장 중반 헬스케어 업종이 2% 넘게 급락하고 국제 유가도 하락 반전하면서 S&P500 지수는 하락세로 돌아섰고 다우 지수도 1만9000선을 다시 내렸지만 통신과 부동산, 소비재 업종이 1% 이상 상승하면서 이를 만

회

- * 美 기존주택 판매 약 10년 만에 최고치...부동산 경기 호조가 지속되고 있다는 의미로 풀이
 - 10월 기존주택 판매량 전월 대비 2% 늘어난 560만채 기록 (조사치 543만채 상회)
- * 국제유가, 석유수출국기구(OPEC)의 감산 합의가 다시 불투명해 지면서 혼조세
 - 이란과 이라크는 여전히 감산 의무를 면제해 줄 것을 요청 & 리비아와 나이지리아도 예외로 인정해 달라고 요구
 - 특히 이란과 이라크는 감산 쿼터를 산정할 때 OPEC이 추정한 산유량이 아닌 자신들이 제시한 산유량을 기준으로 감산 쿼터를 정해야 한다고 주장
- * <유럽 마감> 전일 뉴욕증시가 사상 최고치를 경신하며 유럽까지 훈풍이 전해짐... 광산 및 에너지 관련주가 상승세를 주도
- * <상하이 마감> 투자 심리가 유지되면서 이틀 연속 오름세
- * <도쿄 마감> 후쿠시마 인근에서 발생한 지진에도 국제유가 급등으로 인한 에너지주 강세로 소폭 상승 마감
 - 日 아소 재무상 '후쿠시마 현 앞바다에서 발생한 강진이 금융권에 미치는 영향은 제한적'
 - 실제로 안전 통화인 엔화는 소폭 올랐지만 상승폭은 제한됐고 도쿄 증시는 보험권에서 등락하며 횡보

DOW30	19023.87	(+0.35%)
NASDAQ	5386.35	(+0.33%)
S&P500	2202.94	(+0.22%)
NIKKEI225	18162.84	(+0.31%)
SHANGHAI	3248.35	(+0.94%)
FTSE100	6849.72	(+0.62%)
DAX30	10713.85	(+0.27%)
CAC40	4548.35	(+0.41%)

3.글로벌 환시

- * 달러화, 지난 2주간 도널드 트럼프 대통령 당선인의 재정정책 확대와 물가 상승 기대로 12월 기준금리 인상 가능성이 한때 100%를 웃돌았음에도 숨 고르기 장세를 보이며 보험세

위안화, 13거래일 만에 절상 고시 (-0.30%)

유로/달러	1.0623	(-0.0002)
유로/엔	117.99	(+0.01)
달러/엔	111.04	(+0.00)
달러/위안	6.8779	(-0.0206)
파운드/달러	1.2423	(-0.0069)

NDF 1169.50 / 1170.50원...6.35원 하락

4.글로벌 상품

* <국제 유가> OPEC의 감산 합의가 다시 불투명해 지면서 WTI 가격은 낮아지고 브렌트유 가격은 높아지는 혼조세

* <국제 금값> 최근 가격 하락에 따른 숏커버용 매수세가 유입돼 소폭 상승

WTI 48.03 (-0.4%)

COMEX금 1211.20 (+0.1%)

5. 전일 국내 지표

코스피 1983.47 (+0.89%)

코스닥 610.74 (+0.23%)

원/달러 1176.10 (-10.50)

KTB 109.25 (-0.07)

LKTB 125.35 (-0.22)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리, 장중 강세 흐름을 접고 혼조세로 마감. 외인의 단기물 매도로 단기물 약세에 대한 부담이 중장기구간으로 확대.

CD(91d) 1.4200% (+0.01bp)

[국고채]

1y 1.6260% (+1.70bp)

3y 1.7500% (+1.50bp)

5y 1.8970% (+1.70bp)

10y 2.1500% (+2.00bp)

20y 2.2370% (+1.20bp)

30y 2.2550% (+1.00bp)

50y 2.2420% (+1.00bp)

[통안채]

1y 1.6250% (+1.80bp)

2y 1.7490% (+1.90bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1Y	-17.50bp (-0.80bp)
2Y	-25.15bp (-1.40bp)
3Y	-19.50bp (-1.00bp)
5Y	-22.70bp (-0.45bp)
10Y	-29.25bp (-0.50bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 국채선물 약세전환으로 소폭 상승 마감. 2년물 위주로 거래가 잦았음.

* CRS 금리도 상승. 1년물 위주로 여러 차례 거래.

*IRS 금리

1Y	1.4500% (+1.00bp)
2Y	1.4975% (+0.50bp)
3Y	1.5550% (+0.50bp)
5Y	1.6700% (+1.25bp)
7Y	1.7550% (+1.75bp)
10Y	1.8575% (+1.50bp)

1*2Y	4.75	(-0.50bp)
2*3Y	5.75	(-0.00bp)
2*5Y	17.25	(+0.75bp)
3*5Y	11.50	(+0.75bp)
5*7Y	8.50	(+0.50bp)
5*10Y	18.75	(+0.25bp)

*CRS 금리

1Y	0.9550% (+2.50bp)
2Y	0.9300% (+2.50bp)
3Y	0.9650% (+2.50bp)
5Y	1.0000% (+2.00bp)
7Y	1.0250% (+2.00bp)
10Y	1.0400% (+2.00bp)

9. 주요뉴스

[해외]

- * 구로다 하루히코 BOJ 총재, 장기금리와 관련해 '상당 정도 컨트롤 할 수 있다'
 - '국채 매입과 마이너스 금리의 조합이 수익률 곡선에 영향을 미치는 데 있어 매우 효과적'
 - 10년물 일본 국채 금리를 '제로(0%) 정도'로 유지한다는 현재 장기금리 목표제에 대해서는 '특정 목표 및 허용범위를 말할 수 없다'고 밝힘
- * 피치, 중국 국가 신용등급 'A+'로 유지 & 신용등급 전망은 '안정적' 부여
- * 中 선강통 개통 시기가 당초 예상보다 늦어진 가운데 발표 시기 '초읽기'
 - 홍콩증권거래소 총재 '앞으로 1~2주 내에 발표되고 11월이나 12월의 월요일이 될 수 있다'

[국내]

- * CCP 청산, 달러 IRS 이어 NDF까지 확대되는 배경
 - 장외파생시장이 금융시장 리스크 전파 주요 경로로 지목
 - 유럽연합(EU)과 주요 4개 통화(달러·유로·엔·파운드)의 IRS 거래 청산 단계적 의무화
 - 내달 21일부터 시중은행 등 국내 금융기관이 EU와 거래할 경우 CCP 청산 의무 발생
 - 달러 IRS의 CCP 자율청산, 4분기부터 시행
 - 내년부터 달러·원 차액결제선물환(NDF)으로 자율청산 대상 확대 예정
 - 기타 외화 IRS와 통화스와프(CRS), 신용부도스와프(CDS) 등의 CCP 자율 청산도 2018년부터 단계적으로 적용
- * 기재부, 올해 국고채 물량 한도대비 8~9조 줄여
 - ...다음달 발행물량 5조5천억원 미만 가능성
- * 거래소, 중국은행과 원·위안선물 시장조성계약
- * 앞으로 ELS 스트레스 테스트 · 구분관리 계정 도입
 - ...'헤지 전용 계좌' 허용...삼성전자 1억원 현물 매수시 예약금 없이 선물 거래 가능
- * '한진해운 자산인수' 대한해운, 신용등급 하향검토대상

금일 예정 지표

일본 근로감사의 날로 금융시장 휴장

[연방공개시장위원회(FOMC) 11월 정례회의 의사록]

[영란은행(BOE) 금융정책위원회 회의]

미국-10월 제조업 PMI (예상:53.4, 이전:53.4)

-10월 내구재수주(MoM) (예상:1.5%, 이전:-0.3%)

-
- 10월 근원 내구재수주 (예상:0.2%, 이전:0.1%)
 - 9월 주택가격지수(MoM) (예상:0.5%, 이전:0.7%)
 - 11월 미시간대 소비자신뢰지수 (예상:91.6, 이전:91.6)
 - 10월 신규주택판매 (예상:592K, 이전:593K) / 신규주택판매(MoM) (예상:-0.2%, 이전:3.1%)
 - 주간 실업보험청구건수 (예상:250K, 이전:235K)
 - 에너지정보청(EIA) 주간 원유재고
 - 유로존-11월 제조업 PMI (예상:53.3, 이전:53.5)
 - 11월 서비스 PMI (예상:53.0, 이전:52.8)
 - 독일-11월 제조업 PMI (예상:54.8, 이전:55.0)
 - 11월 서비스 PMI (예상:54.0, 이전:54.2)
-