

1.글로벌 채권

- * <뉴욕 채권> 국채가격, 낮아진 가격에 매수 욕구가 생긴 해외 투자자의 시장 재진입 등의 요인으로 상승
- * 국채가격, 이날 미 경제지표 발표가 없는 가운데 오는 30일 예정된 OPEC의 감산 합의를 앞둔 불확실성으로 안전자산 선호를 받은 데다 월말 포트폴리오 조정용 매수, 뉴욕증시 하락으로 상승 출발
- * 유럽의 정치 불안으로 유럽 주요국 국채 수익률이 하락한 것도 영향을 미침
- * 국채가, 오후 들어 오전의 범위에서 크게 벗어나지 않는 움직임
- * 최근 3주 동안 도널드 트럼프의 美 대통령 당선 이후 Fed의 빠른 기준금리 인상 기대에 급락한 국채가로 인해 이날 해외발 저가매수세도 등장

[미국]

2y	1.10%	(-1.8bp)
5y	1.79%	(-4.6bp)
10y	2.31%	(-4.5bp)
30y	2.97%	(-3.1bp)

[기타 10Y물]

영국	1.38%	(-3.8bp)
독일	0.20%	(-3.5bp)
프랑스	0.76%	(-1.4bp)
이탈리아	2.06%	(-2.0bp)
스페인	1.56%	(-1.2bp)
그리스	6.82%	(+1.6bp)

2.글로벌 증시

- * <뉴욕 마감> 차익 실현 매물에 '트럼프 효과' 약화... 유가 상승에도 증시 하락 마감
- * 지난주 연일 사상 최고치를 경신한 이후 금융 등 일부 업종의 이익 실현 움직임이 나타나 하락... 중소형주 중심의 러셀2000 지수는 15일간 이어지던 상승세에 마침표
 - 금융업종은 미국 대통령 선거 이후 4% 이상 강세를 보이며 두드러진 상승세를 기록한 데 따라 이날 이익 실현성 매물이 집중되어 1.4% 하락
- * 투자자들 오는 30일 OPEC 회원국과 러시아 등 주요 산유국들의 산유량 감축 관련 공식회담 주목
 - 국제유가, 장초반 하락세를 보이다 이라크 석유장관이 OPEC의 감산 합의에 협력하겠다는 뜻을 밝혔다는 소식에 상승세로 전환
 - 이라크가 하루 산유량을 454만6천배럴로 제한할 방침이며 이란도 생산량 제한을 고려하고 있다는 보도도

시장 심리에 긍정적인 영향

* <유럽 마감> 이탈리아 정치 개혁 국민투표가 부결돼 시장 불안감이 커질 것이라는 우려에 일제히 하락... 은행업종 1.8% 이상 떨어지며 낙폭 두드러짐

* <상하이 마감> 선전증시와 홍콩증시의 교차거래를 허용하는 선강통 기대감으로 상승 마감

* <도쿄 마감> 연이은 증시 상승세로 차익실현 매물이 출회 & 엔 강세로 수출주가 부진에 하락 마감

DOW30	19097.90	(-0.28%)
NASDAQ	5368.81	(-0.56%)
S&P500	2201.72	(-0.53%)
NIKKEI225	18656.89	(-0.13%)
SHANGHAI	3277.00	(+0.46%)
FTSE100	6977.47	(-0.60%)
DAX30	10582.67	(-1.09%)
CAC40	4510.39	(-0.88%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 최근 3주간 급등세 이후 차익실현 매도가 나와 하락

유로/달러	1.0607	(+0.0019)
유로/엔	118.90	(-0.82)
달러/엔	112.10	(-0.96)
달러/위안	6.9042	(-0.0126)
파운드/달러	1.2417	(-0.0060)
NDF	1170.50 / 1171.50원...0.65원 상승	

4.글로벌 상품

* <국제 유가> OPEC이 이번주 산유량 감축 합의에 이를 것이라는 기대로 4거래일 만에 상승세

* <국제 금값> 달러화 가치가 하락하고 뉴욕증시가 약세를 나타낸 데 따라 상승

WTI	47.08	(+2.2%)
COMEX금	1193.80	(+1.1%)

5. 전일 국내 지표

코스피	1978.13 (+0.19%)
코스닥	593.05 (-0.80%)
원/달러	1170.40 (-7.00)
KTB	109.29 (+0.24)
LKTB	125.42 (+0.49)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리, 하락 마감. 한은이 통안채 발행량을 줄이고 정부도 국고채 발행물량을 줄이면서 공급측 부담을 덜었기 때문.

CD(91d) 1.4900% (+0.01bp)

[국고채]

1y	1.6810% (-4.20bp)
3y	1.7480% (-7.50bp)
5y	1.9120% (-5.50bp)
10y	2.1400% (-4.50bp)
20y	2.1940% (-5.60bp)
30y	2.2090% (-5.60bp)
50y	2.1960% (-5.60bp)

[통안채]

1y	1.6790% (-4.50bp)
2y	1.7570% (-6.80bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1Y	-16.90bp (-0.75bp)
2Y	-21.70bp (+0.55bp)
3Y	-16.80bp (+0.75bp)
5Y	-27.20bp(-0.50bp)
10Y	-37.00bp (-2.00bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 전 영업일 되돌림으로 하락 마감. 장 중 변동성보다는 서서히 금리가 내려가는 모습. 비드가 거의 나오지 않음.

* CRS 역시 되돌림 현상으로 크게 하락 마감. 단기물부터 오퍼가 시작돼 전 구간의 금리가 내려갔는데 FX스왑포인트가 전 구간 마이너스(-)를 보인 영향이 컸음.

*IRS 금리

1Y	1.5100%	(-5.25bp)
2Y	1.5400%	(-6.25bp)
3Y	1.5800%	(-6.75bp)
5Y	1.6400%	(-6.00bp)
7Y	1.7000%	(-6.00bp)
10Y	1.7700%	(-6.50bp)

1*2Y	3.00	(-1.00bp)
2*3Y	4.00	(-0.50bp)
2*5Y	10.00	(+0.25bp)
3*5Y	6.00	(+0.75bp)
5*7Y	6.00	(0.00bp)
5*10Y	13.00	(-0.50bp)

*CRS 금리

1Y	-16.90bp	(-0.75bp)
2Y	-21.70bp	(+0.55bp)
3Y	-16.80bp	(+0.75bp)
5Y	-27.20bp	(-0.50bp)
10Y	-37.00bp	(-2.00bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* 마리오 Драги ECB 총재 '물가는 점진적으로 상승했고 ECB의 통화 완화 정책은 지속하는 경제 회복에 주요한 요소가 되고 있다'

- '유로존 정치인들이 경제를 개선하기 위해 경제 개혁을 해야 한다'며 이는 완화적인 통화정책 효율성을 높인다고 주장

* 中 인민은행 부행장 '위안화는 세계 화폐 체계에서 여전히 안정적인 강세를 나타내는 특징을 보인다'

- 도널드 트럼프가 미국 대통령에 당선된 이후 위안화 절하 속도가 빨라진 가운데 중국 인민은행이 위안화 환율에 대해 내놓은 첫 공식 입장

- 달러 대비 위안화의 변동성이 심해진 것은 도널드 트럼프의 미국 대통령 당선, 美 기준금리 인상 가능성 증대, 브렉시트, 이집트파운드의 파동 등 외부요인 때문이라고 분석

- '위안화가 달러 대비 가치는 다소 떨어졌지만 그 절하폭은 다른 통화에 비해 상대적으로 작다'고 강조

- * 이탈리아의 개헌안이 국민투표에서 부결된다면 최다 8개의 이탈리아 은행 도산 위기 <파이낸셜타임스>
 - 국민투표가 부결되면 사임하겠다고 공언한 마테오 렌치 총리의 퇴진으로 정치 불확실성이 장기화하면서 부실 우려를 받아온 8개 은행의 자본확충이 실패, 결국 이 은행들이 정리 수순을 밟을 것이라는 전망

[국내]

- * 임종룡 "주식시장 건조...금리 시장 변동성 큰 부담"
- * 유일호 "국채 매입, 국민연금이 판단할 사항"
- * 한은 "내년 수출 증가 여건은 악화"
 - "경기 개선세 미약...주력산업 부진 지속"
- * 국고 3년 1.35조 1.755% (-5.6bp) 낙찰...응찰 4.73조
- * 과거 사례로 본 대통령 탄핵...금리에 미칠 파장은
 - 과거 사례를 보면 탄핵이슈로 채권 금리가 오른 후 진정
 - 그러나 이번 탄핵이슈가 국가신용도에 영향을 준다면 금리가 오르겠지만, 그 이전까지는 영향이 제한적이라고 평가
 - 이번 대통령 탄핵이 실제 채권금리 상승으로 이어질 가능성이 작다는 의견도 나옴. 외국인의 채권투자 흐름에 달렸다는 설명
- * 국민연금,채권 포트폴리오 조정..."공사·은행채 확대"
- * ELS 온라인 투자 까다로워진다...자가진단 절차 의무화

금일 예정 지표

- [스탠리 피셔 Fed 부의장 연설]
- [윌리엄 더틀리 뉴욕연은 총재 연설]
- [제롬 파월 연준 이사 연설]
- [영란은행(BOE) 실질금리]

- 미국-3분기 GDP (예상:3.0%, 이전:2.9%)
 - 9월 20대 대도시 주택가격지수(YoY) (예상:5.2%, 이전:5.1%)
 - 11월 소비자신뢰지수 (예상:100.0, 이전:98.6)
- 일본-10월 소매판매(YoY) (예상:-1.2%, 이전:-1.9%)
 - 10월 가계지출(MoM) (예상:0.1%, 이전:2.8%)
 - 10월 실업률 (예상:3.0%, 이전:3.0%)
- 독일-11월 CPI(MoM) (예상:0.1%, 이전:0.2%)

