

1.글로벌 채권

- * <뉴욕 채권> 국채가격, 유가 하락과 월말 포트폴리오 조정용 매수세에 힘입어 상승
- * 국채가격, 거래량이 많지 않은 가운데 3분기 국내총생산(GDP) 등 지표 호조로 하락 출발
 - 9월 미국의 주택가격도 예상을 넘는 전년대비 상승세를 보여, 국채가 하락에 영향
- * 다음날 석유수출국기구(OPEC)의 감산 합의와 관련한 최종 회의를 앞둔 불확실성으로 내린 유가는 국채가격을 지지하는 작용
- * 국채가, 오후 들어 제롬 파월 연준 이사의 다음달 금리 인상 시사 발언에도 월말 포트폴리오 조정용 매수세와 연기금, 보험사의 매수세 등장에 반등
 - Fed 제롬 파월 이사 '내 견해에서 기준금리를 인상할 근거가 이달 초의 FOMC 정례회의 이후 더 강화됐다'며 다음달 기준금리 인상할 수 있다는 점 시사

[미국]

2y	1.09%	(-1.2bp)
5y	1.78%	(-1.3bp)
10y	2.29%	(-2.1bp)
30y	2.95%	(-3.0bp)

[기타 10Y물]

영국	1.37%	(-1.0bp)
독일	0.22%	(+1.7bp)
프랑스	0.69%	(-6.8bp)
이탈리아	1.94%	(-12.4bp)
스페인	1.50%	(-5.2bp)
그리스	6.80%	(-2.7bp)

2.글로벌 증시

- * <뉴욕 마감> 유가 급락 불구 美 경제지표 호조에 상승 마감
- * 강보합으로 출발한 지수는 장중 상승폭을 소폭 확대... 미국 경제 성장률이 상향조정되는 등 지표가 긍정적으로 발표된 것이 투자 심리에 긍정적인 영향
- * 국제 유가가 러시아의 석유수출국기구(OPEC) 회동 불참 선언 여파로 4% 가까이 급락
 - 러시아 석유장관 'OPEC 총회에 참가할 계획이 없다' ... 다만 OPEC이 합의를 도출할 경우 러시아는 협상에 나설 의향이 있다고 전함
 - 이란 석유장관, 이날 산유량 감축에 동참하지 않을 것이라는 입장을 재확인
- * 3분기 美 경제 성장률, 소비지출과 기업 이익의 증가로 지난달 나온 속보치보다 상향 조정

- 3분기 GDP 성장률 잠정치, 속보치 연율 2.9%보다 상향조정된 3.2%... 2년 만에 최고치
- 3분기 소비지출 2.8% 증가 / 3분기 기업 세후 순익은 전분기 대비 3.5% 증가하면서 3분기 연속 증가세

* 美 소비자신뢰지수가 9년 만에 최고치를 기록하며 예상치 크게 상회
 - 11월 소비자신뢰지수, 전월치(98.6)와 예상치(101.2)를 모두 뛰어넘는 107.1 집계...2007년 7월 이후 최고치

* 9월 전미주택가격지수, 전년 대비 5.5% 상승하며 10년 2개월래 최고치 기록

* <유럽 마감> 석유수출국기구(OPEC)의 회담과 이탈리아 국민투표에 대한 관망세로 혼조 마감
 - 유럽중앙은행, 이탈리아 국민투표 결과에 따라 금융시장이 불안해 질 경우 국채 매입을 늘릴 준비가 돼 있다고 밝혀... 은행 업종 지수 0.6% 상승

* <상하이 마감> 선전증시와 홍콩증시의 교차거래를 허용하는 선강통 기대감으로 상승 했으나 A주의 대형주들이 부진한 모습을 보이면서 상승폭 제한

* <도쿄 마감> 엔화 시세가 한때 달러당 111엔대 전반까지 상승하는 등 강세를 보이자, 수출 기업의 실적 악화 우려가 주가 하락

DOW30	19121.60	(+0.12%)
NASDAQ	5379.92	(+0.21%)
S&P500	2204.66	(+0.13%)
NIKKEI225	18307.04	(-0.27%)
SHANGHAI	3282.92	(+0.18%)
FTSE100	6772.00	(-0.40%)
DAX30	10620.49	(+0.36%)
CAC40	4551.46	(+0.91%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 3분기 미국 경제 성장률 호조 속에도 엔화에는 올랐지만 유로화에는 내리는 혼조세

유로/달러	1.0645	(+0.0038)
유로/엔	119.68	(+0.78)
달러/엔	112.42	(+0.32)
달러/위안	6.8889	(-0.0153)
파운드/달러	1.2493	(+0.0076)
NDF	1167.70 / 1168.50원...0.45원 하락	

4.글로벌 상품

* <국제 유가> OPEC 회원국들의 감산 합의를 둘러싼 불확실성에 급락

* <국제 금값> 미국 기준금리 인상 전망이 강화돼 하락 마감

WTI 45.23 (-3.9%)
COMEX금 1190.80 (-0.3%)

5. 전일 국내 지표

코스피 1978.39 (+0.01%)
코스닥 596.07 (+0.51%)
원/달러 1168.50 (-1.90)
KTB 109.33 (+0.04)
LKTb 125.42 (0.00)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리, 하락 마감. 한은이 통안채 발행량을 줄이고 정부도 국고채 발행물량을 줄이면서 단기물을 중심으로 안정세를 보임. 국고채 30년물 입찰은 비경쟁인수물량이 없었지만, 장투기관과 외인 매수가 들어오면 선방했다고 평가.

- 국고 30년 4천억 2.205%에 낙찰...응찰 1.343조

CD(91d) 1.5200% (+0.03bp)

[국고채]

1y 1.6610% (-2.00bp)
3y 1.7100% (-3.80bp)
5y 1.9070% (-0.50bp)
10y 2.1380% (-0.20bp)
20y 2.1570% (-3.70bp)
30y 2.1670% (-4.20bp)
50y 2.1550% (-4.10bp)

[통안채]

1y 1.5610% (+5.00bp)
2y 1.7000% (+9.00bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1Y -13.60bp (+3.30bp)

2Y	-18.00bp	(+3.70bp)
3Y	-13.00bp	(+3.80bp)
5Y	-26.70bp	(+0.50bp)
10Y	-36.80bp	(+0.20bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 단기물을 제외하고 거의 변동 없음. 단기물 위주로 거래가 많았지만 금리 변동 폭은 작음.

* CRS, 변동성 확대 속 전일 되돌림으로 큰 폭 상승 마감. 커브 스티프닝.

*IRS 금리

1Y	1.5250%	(+1.50bp)
2Y	1.5400%	(0.00bp)
3Y	1.5800%	(0.00bp)
5Y	1.6400%	(0.00bp)
7Y	1.7000%	(0.00bp)
10Y	1.7700%	(0.00bp)

1*2Y	1.50	(-1.50bp)
2*3Y	4.00	(0.00bp)
2*5Y	10.00	(0.00bp)
3*5Y	6.00	(0.00bp)
5*7Y	6.00	(0.00bp)
5*10Y	13.00	(0.00bp)

*CRS 금리

1Y	0.9900%	(+2.00bp)
2Y	1.0500%	(+6.00bp)
3Y	1.0750%	(+6.50bp)
5Y	1.1250%	(+8.50bp)
7Y	1.1350%	(+8.00bp)
10Y	1.1200%	(+5.50bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* ECB 드라기 '저금리 기간이 지속하면서 부채 증가와 과도한 위험 선호 등 금융 시장 리스크가 커지는 환경이 조성됐다' 경고

- 지난 2년 동안 중단없는 경기 부양 조치를 통해 기준 금리를 마이너스권으로 내리고 1조3천억 유로를 넘는 국채와 회사채를 사들인 덕분에 유로존의 차입비용이 낮아졌지만, 주식과 채권, 부동산을 비롯한 각종 자산 가격의 상승같은 부작용 유발

- 드라기 총재는 그럼에도 ECB의 경기부양 정책들은 유로존의 경기 회복에 중요한 요소였다고 강조하고 앞으로도 지속할 가능성이 있음을 시사

* 일본 10월 실업률, 전망치이자 전달 수치와 같은 3.0% 집계... 유효 구인배율은 1.40배로 25년 2개월래 최고치

- 완전 실업자 수는 9월에 비해 5만명 줄어든 197만명으로 실업자 수가 200만명을 밑돈 것은 1995년 2월 이래 21년8개월래 처음

* 美 3분기 개인소비지출(PCE) 가격지수, 이전과 같은 1.4% 기록

- 기업 이익 증가가 노동자의 임금 상승으로 이어지지 않는 점을 확인해줘, 향후 연준이 공격적으로 금리 인상 속도를 높이는 것을 제한할 요인으로 분석

[국내]

* 금통위원 "경제상황 악화하면 통화완화 기조 강화해야"

* 금통위원 "대내외 정치·경제불안 성장 불확실성 높아져"

* 금통위원 "완화적 통화정책 기조 유지 위한 채권매입 한계 도달"

금일 예정 지표

[연준 베이지북]

[로버트 카플란 달러스 연은 총재 연설]

[로레타 메스터 클리블랜드 연은 총재 연설]

[뉴욕 연은 가계부채·신용보고서]

한국-10월 산업생산(YoY) (예상:-2.0%, 이전:-2.0%) / 산업생산(MoM) (예상:-0.1%, 이전:0.3%)

일본-10월 산업생산(MoM) (예상:-0.1%, 이전:0.6%)

유로존-11월 CPI(YoY) (예상:0.6%, 이전:0.5%)

영국-11월 GfK 소비자신뢰지수 (예상:-4, 이전:-3)

독일-11월 실업률 (예상:6.0%, 이전:6.0%)

-10월 소매판매(MoM) (예상:1.0%, 이전:-1.4%)

미국-11월 ADP 비농업부문 고용변화 (예상:165K, 이전:147K)

-10월 개인지출(MoM) (예상:0.5%, 이전:0.5%)

- 10월 근원 PCE 물가지수(YoY) (이전:1.7%) / (MoM) (예상:0.1%, 이전:0.1%)
 - 11월 시카고 PMI (예상:52.0, 이전:50.6)
 - 10월 잠정주택판매(MoM) (예상:0.4%, 이전:1.5%)
 - 원유재고 (이전:-1.255M)
-