1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가격, 지정학적 우려로 커졌던 안전자산 선호가 약해지며 차익실현 매도가 나온 가운데 장기물은 내리고 단기물은 거의 변동이 없는 혼조세

*국채가, 전일 유럽발 테러 이후 나타났던 안전자산 선호가 약화해 하락 출발

* 오후 들어 저점매수에 낙폭을 줄였지만 반등까지 하지는 못함

[미국]
2y 1.22% (-0.6bp)
5y 2.04% (+1.7bp)
10y 2.56% (+2.0bp)
30y 3.14% (+1.8bp)

[기타 10Y물]
영국 1.40% (+0.8bp)
독일 0.26% (+2.1bp)
프랑스 0.71% (+1.2bp)
이탈리아 1.83% (+2.0bp)
스페인 1.33% (-2.6bp)
그리스 7.05% (+0.0bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 새 정부의 경제 정책 기대감 지속... 다우 & 나스닥 사상 최고

* 내년 기준금리 인상 가속화에 따른 금융주 강세 등이 지수 상승 원동력...은행 업종 지수 1.12% 오르며 가장 높은 상승률

* 달러, BOJ의 금리 동결과 유럽의 테러 영향으로 다시 14년 만에 최고치까지 상승
  - 달러 인덱스 한 때 103.55까지 상승하며 2002년 12월 이후 14년 만에 가장 높은 수준

* <유럽 마감> 기업들의 활발한 M&A 활동과 이탈리아의 은행 안정화가 진전을 보인 것이 호재로 작용하며 상승 마감
  - 이탈리아 정부, 은행부문 지원 위해 의회에 200억 유로 대출 승인 요청

* <상하이 마감> 유동성 우려가 이어지며 이틀 연속 하락

* <도쿄 마감> 엔화 약세와 더불어 일본은행(BOJ)이 경제평가를 상향조정한 것이 호재로 작용해 상승

DOW30 19974.62 (+0.46%)
NASDAQ 5183.94 (+0.49%)
S&P500 2270.76 (+0.36%)
NIKKEI225 19494.53 (+0.53%)
SHANGHAI 3102.88 (-0.49%)
FTSE100 7043.96 (+0.38%)
DAX30 11464.74 (+0.33%)
CAC40 4849.89 (+0.56%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 주요 선진국 중 유일하게 미국이 기준금리 인상에 나선다는 점이 주목받아 상승

유로/달러 1.0389 (-0.0010)
유로/엔 122.40 (+0.58)
달러/엔 117.81 (+0.69)
달러/위안 6.9468 (+0.0156)
NDF 1192.50 / 1193.50원...0.10원 상승

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 달러 강세에도 불구하고 미국의 원유 재고가 늘어나지 않았을 것이란 전망에 힘입어 소폭 상승
* <국제 금값> 달러화가 강세를 보인 데 따라 하락

WTI 52.23 (+0.2%)
COMEX금 1133.60 (-0.8%)

5. 전일 국내 지표

코스피 2041.94 (+0.17%)
코스닥 617.99 (-0.77%)
원/달러 1193.40 (+6.50)
KTB 109.28 (-0.07)
LKTB 124.80 (-0.06)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리, 약보합세로 마감. 주요국 통화정책 이벤트가 마무리되면서 연말 박스권 장세 진입.
- 유럽 지역 테러 발생으로 인한 안전자산 선호 분위기에 하락한 미 금리 영향으로 강세 출발.
- 기재부 1차관이 10년내 국내 잠재성장률이 1%대로 급락할 수 있다고 발언하면서 금리 하락폭 키워.
- 국채선물, 매도 미결제를 가지고 있던 증권사/운용사에서 막판 롤오버에 나서며 10선 12월물은 70틱 이상 상승. 3월물과의 스프레드도 50틱 이상 벌어짐.
- 국채선물 3월물로 롤오버가 완료되고 3월물 저평가를 해소하기 위해 매수세가 일부 유입됐지만, 강세폭이 크지 않았음.

CD(91일) 1.540% (0.0bp)

[국고채]
1y 1.5800% (+1.20bp)
3y 1.7250% (+1.80bp)
5y 1.8850% (+0.50bp)
10y 2.1770% (0.00bp)
20y 2.2100% (-0.50bp)
30y 2.2200% (0.00bp)
50y 2.2150% (0.00bp)

[통안채]
1y 1.5700% (+1.00bp)
2y 1.6970% (+2.70bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1y -6.00bp (0.00bp)
2y -15.70bp (-0.70bp)
3y -14.25bp (-0.55bp)
5y -18.25bp (0.00bp)
10y -27.20bp (+0.25bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 소폭 상승 마감. 2~3년 구간으로 페이가 이어짐.
* CRS, 에셋스왑 물량이 이어지면서 이틀째 큰 폭 하락. 환율 상승과 위안화 등 영향도 있겠지만 일단은 수급 때문으로 추정.

*IRS 금리

1Y 1.5100% (+1.00bp)
2Y 1.5400% (+2.00bp)

3Y 1.5825% (+1.25bp)
5Y 1.7025% (+0.50bp)
7Y 1.7850% (0.00bp)
10Y 1.9050% (+0.25bp)

1*2Y 3.00 (+1.00bp)
2*3Y 4.25 (-0.75bp)
2*5Y 16.25 (-1.50bp)
3*5Y 12.00 (-0.75bp)
5*7Y 8.25 (-0.50bp)
5*10Y 20.25 (-0.25bp)

*CRS 금리

1Y 0.8950% (-11.00bp)
2Y 0.9950% (- 9.00bp)
3Y 1.0950% (- 8.00bp)
5Y 1.2150% (- 4.50bp)
7Y 1.2200% (- 4.50bp)
10Y 1.2100% (- 4.50bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* BOJ, 당좌계정 일부에 적용하는 금리는 -0.1%로, 10년 만기 국채 금리는 '0% 정도'로 각각 동결… 연간 국채매입 규모를 80조엔으로 유지
- 9명의 BOJ 금융정책 결정위원 가운데 7명이 현행 장단기 금리 목표 동결과 자산매입 유지에 찬성
- 일본 경제에 대한 평가를 '추세로써 완만하게 계속 회복되고 있다'고 다소 긍정적으로 수정

* 구로다 BOJ 총재, '현재 수익률 곡선 형태 적절… 10년물 금리를 언제 올릴지 논의하기 시작하는 것은 시기상조'
- 2% 물가 목표 달성까지는 아직 거리 있어… 목표를 최대한 빨리 달성하기 위해 강력한 완화를 지속하는 것이 가장 적절하다고 강조
- 최근 엔화 가치 하락에 대해서는 '지난 2월 수준'이라며 놀라운 수준은 아니라고 판단

* 독일 11월 PPI 전월 대비 예상치(+0.1%) 상회하는 0.3% 상승 기록

* 中 인민은행장 '중국에서의 자본유출을 억제하기 위해 시행하는 현 조치들이 일시적인 수단'

* 호주중앙은행(RBA) 12월 의사록 '고용시장 모멘텀과 관련해 여전히 상당한 불확실성이 있다… 이는 인플레이션이 보다 정상적인 수준으로 되돌아가기에 앞서 당분간 낮게 유지될 것임을 시사한다'고 판단

[국내]

* 국금센터 "韓환율조작국 가능성 작아…변동성 억제 지속"

* 유일호 "내년 1분기 경제 실적치 보고 추경 편성 여부 결정"

* 유일호 "하방리스크 때문에 내년 3% 성장 유지 어려워"

* 유일호 "한·일 통화스와프 최대한 빨리 재개 노력"

* 김진표 "내년 한은 금리인상 불가피…20조 추경해야"

* 민주당 "내년 하반기 한은 금리인상 가능성…정부 확장적 재정 펴야"

* 기재부 국채 발행…초장기물 스프레드 해소에 방점둘까

* 채권 등 장외파생거래 담보 규모 6.1조원

* 최상목 기재차관 "10년내 잠재성장률 1% 경고 귀기울여야"

금일 예정 지표

[태국 / 스웨덴 기준금리 결정]

미국-11월 기존주택판매(MoM) (예상:-1.0%, 이전:2.0%)
-11월 기존주택판매 (예상:5.50M, 이전:5.60M)
-원유재고 (이전:-2.563M)