

1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가격, 저가매수세로 강보합세

* 국채가, 연말 연휴로 거래가 한산한 가운데 수익률의 소폭 하락으로 강보합세로 출발

* 오후 들어 조기에 등장한 월말 매수세로 국채가 오름폭을 소폭 더 늘림

[미국]

2y 1.19% (-2.6bp)

5y 2.02% (-2.0bp)

10y 2.53% (-2.4bp)

30y 3.11% (-3.0bp)

[기타 10Y물]

영국 1.39% (-1.5bp)

독일 0.24% (-2.1bp)

프랑스 0.69% (-1.9bp)

이탈리아 1.82% (-1.7bp)

스페인 1.36% (+2.9bp)

그리스 7.05% (+0.0bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> '트럼프 강세장' 숨고르기... 차익실현 매물에 약보합

* 크리스마스 연휴를 앞두고 시장을 움직일만한 뚜렷한 재료가 없는 가운데 최근 단기 급등 부담에 따른 기술적 내림세

* 부동산 업종 지수는 1.32% 급락 & 헬스케어 업종 지수도 0.6% 밀리며 하락세 주도

* 美 기존주택판매, 전월대비 0.7% 증가한 561만호로 집계... 2007년 2월 이후 가장 높은 수준이며 예상치 554만호 크게 웃도는 수준

- 주택 가격과 모기지론 금리 상승세가 지속되면서 주택 구매가 증가한 것으로 보인다는 분석

* <유럽 마감> 스페인 등의 은행주 부진... 독일을 제외하고 일제히 하락

* <상하이 마감> 중국 정부가 다시 국영기업 개혁에 초점을 맞추면서 낙관적인 분위기를 형성... 투자심리 회복되며 상승

* <도쿄 마감> 이익 실현 움직임이 일면서 하락

DOW30	19941.96	(-0.16%)
NASDAQ	5471.43	(-0.23%)
S&P500	2265.18	(-0.25%)
NIKKEI225	19444.49	(-0.26%)
SHANGHAI	3137.43	(+1.11%)
FTSE100	7041.42	(-0.04%)
DAX30	11468.64	(+0.03%)
CAC40	4833.82	(-0.33%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 전일 상승한 데 따른 차익실현 매도로 하락

유로/달러	1.0430	(+0.0041)
유로/엔	122.61	(+0.21)
달러/엔	117.53	(-0.28)
달러/위안	6.9489	(+0.0021)
NDF	1194.50 / 1195.00원...1.50원 상승	

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 미국의 예상 밖 원유 재고 증가 영향으로 일제히 하락

* <국제 금값> 달러화가 약세를 보였음에도 소폭 하락

WTI	52.49	(-1.5%)
COMEX금	1133.20	(-0.02%)

5. 전일 국내 지표

코스피	2037.96	(-0.19%)
코스닥	618.63	(+0.10%)
원/달러	1193.90	(+0.50)
KTB	109.47	(+0.19)
LKTB	125.65	(+0.85)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리, 외국인 국채선물 매수세 확대에 더불어 장 마감 이후 발표되는 내년도 국고채 발행계획에서 초장기물 물량 축소 기대에 하락 마감.

- 오후 들어 외국인이 3년 국채선물 매수세를 1만계약까지 늘리고, 정부가 내년 경제성장률 전망 2%대로 하향 조정할 전망에 강세폭 더욱 확대.

* 기재부 "내년 국채 50년물 1조...총 103.7조 발행"

CD(91일) 1.540% (0.00bp)

[국고채]

1y	1.5700%	(-1.00bp)
3y	1.6820%	(-4.30bp)
5y	1.8250%	(-6.00bp)
10y	2.1020%	(-7.50bp)
20y	2.1230%	(-8.70bp)
30y	2.1330%	(-8.70bp)
50y	2.1280%	(-8.70bp)

[통안채]

1y	1.5580%	(-1.20bp)
2y	1.6700%	(-2.70bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1y	-6.30bp	(-0.30bp)
2y	-16.75bp	(-1.05bp)
3y	-14.20bp	(+0.05bp)
5y	-19.00bp	(-0.75bp)
10y	-27.45bp	(-0.25bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 국고채 금리 하락에 연동되어 동반 강세.

* CRS, 에셋스왑 물량이 계속 유입되면서 3거래일 연속 하락 마감.

*IRS 금리

1Y	1.4950%	(-1.50bp)
2Y	1.5025%	(-3.75bp)
3Y	1.5400%	(-4.25bp)
5Y	1.6350%	(-6.75bp)

7Y 1.7150% (-7.00bp)
10Y 1.8275% (-7.75bp)

1*2Y 0.75 (-2.25bp)
2*3Y 3.75 (-0.50bp)
2*5Y 13.25 (-3.00bp)
3*5Y 9.50 (-2.50bp)
5*7Y 8.00 (-0.25bp)
5*10Y 19.25 (-1.00bp)

*CRS 금리

1Y 0.8800% (-1.50bp)
2Y 0.9750% (-2.00bp)
3Y 1.0500% (-4.50bp)
5Y 1.1300% (-8.50bp)
7Y 1.1300% (-9.00bp)
10Y 1.1200% (-9.00bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* 美 에너지정보청 EIA, 주간 원유재고 220만배럴 증가... 250만배럴 감소할 것이란 전문가 예상과는 정반대 결과

* 태국 중앙은행 기준금리를 현행 1.5%로 동결... 7명의 통화정책위원 전원이 찬성

* 스웨덴, 기준금리 환매조건부채권(레포) 금리를 현행 -0.50%로 동결... 국채 매입 규모를 300억 크로나 확대하며 내년 상반기에도 관련 작업을 지속해 나갈 계획이라고 설명

* 피치, 인도네시아 신용등급 전망 기존 '안정적'에서 '긍정적'으로 상향 조정... 인도네시아 정부가 낮은 부채 부담, 낙관적인 경제 성장 전망 등에 근거해 등급 전망을 높였다고 설명

[국내]

* 금리는 빠고 '추경' 불 지피는 야당...채권시장 영향은

- 박근혜 대통령에 대한 탄핵소추로 정국의 주도권을 잡은 더불어민주당이 추가경정예산(추경) 필요성을 역설
- 민주당은 반면 가계부채 우려와 미국의 금리 인상 등으로 추가적인 기준금리 인하에는 반대 입장
- 민주당의 주장대로 금리정책은 배제하고 대규모 추경을 통한 경기 부양이 현실화하면 국내 채권금리의 상승 압력이 가중될 것이란 진단

* 한국거래소, 미국달러 IRS 장외 청산 개시

* 한은 2017년 통계 발표일정 확정...올해 GDP 1월25일 발표

* 한은 "보호무역에 2017~2020년 수출의 0.8% 차질"

* 통안 2년물 1.70%에 1.83조 낙찰...응찰 3.04조

* 채권시장 中 금리 급등에 긴장... "亞 자금 이탈 도미노 우려"

- 도널드 트럼프 미국 대통령 당선 이후 중국 국채금리가 단기물을 중심으로 폭등.
- 중국 위안화를 비롯한 아시아 통화 약세를 동반해 우리나라를 비롯한 신흥국에서 외국인 자금이탈을 자극하는 등 도미노 현상으로 이어질 수 있어서 우려.

* 에셋물량 폭탄에 달러 부족...CRS 추가로 놀리나

- CRS 금리, 최근 큰 폭 하락. 연말장세로 에셋스와프 물량을 받아낼 비드가 실종된 것으로 풀이.
- 일부 시장참가자들은 신흥국 달러 유동성 부족 현상이 심화될 수 있다고 우려.
- 수급 요인으로 연말까지 CRS 금리가 회복되기는 쉽지 않다고 전망. 또 아시아 신흥국의 자금 이탈 여부도 살펴야한다고 강조.

금일 예정 지표

[유럽중앙은행(ECB) 경제보고서]

[필리핀 / 대만 기준금리 결정]

미국-GDP(QoQ) (예상:3.3%, 이전:3.2%)

- 11월 근원 내구재수주(MoM) (예상:0.2%, 이전:0.8%)
- 11월 내구재수주(MoM) (예상:-4.7%, 이전:4.6%)
- 11월 시카고연은 전미활동지수 (이전:-0.08)
- 10월 주택가격지수(MoM) (예상:0.4%, 이전:0.6%)
- 11월 근원 PCE물가지수(MoM) (이전:1.7%) / (YoY) (예상:0.1%, 이전:0.1%)
- 11월 개인지출(MoM) (예상:0.3%, 이전:0.3%)
- 실업보험청구자수 (예상:256K,이전:254K)