1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가격, 경제지표 호조에 최근 잠잠했던 매도세가 재등장해 하락

* 국채가격, 다음날 추수감사절 휴장을 앞두고 거래량이 감소한 가운데 내구재 수주 등 경제지표 호조 행진으로 하락 출발

* 美 경제지표가 전반적인 호조세를 나타낸 반면 신규 주택판매가 예상 밖으로 하락하면서 국채가 하락에 제동

* 국채가, 오후 들어 7년물 입찰에서 해외 수요가 확인되고 11월 FOMC 의사록이 지난주 재닛 옐런 연준 의장의 발언 수준인 데다 2017년 빠른 긴축 기조에 대한 증거를 제시하지 못하자 낙폭을 좀 더 줄인 후 횡보
- 美 재무부 $280억 어치의 7년 만기 국채 연 2.215%에 발행... 응찰률은 2.68배를 보여, 최근 평균치 2.5배를 상회했으며 해외 중앙은행 등 간접입찰자들의 낙찰률은 72.7%로 최근 평균 62%를 웃돔

[미국]

2y	1.13%	(+4.0bp)
5y	1.83%	(+6.4bp)
10y	2.35%	(+4.1bp)
30y	3.02%	(+2.4bp)

[기타 10Y물]

영국	1.46%	(+8.7bp)
독일	0.26%	(+4.4bp)
프랑스	0.78%	(+7.5bp)
이탈리아	2.11%	(+9.5bp)
스페인	1.59%	(+7.2bp)
그리스	6.79%	(+0.8bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 경기지표 호조에도 불구하고 국제 유가 하락과 기술주 부진 영향으로 혼조세... S&P 500과 다우존스산업평균 지수는 사상 최고치 행진을 이어간 반면 나스닥종합 지수는 하락

* FRB 정책위원 대부분 기준금리를 '비교적 이른 시간에(relatively soon)' 인상할 수 있을 것이라는데 동의 <11월 FOMC 의사록>
- 고용 시장과 물가상승이 추가적으로 개선될 것이라는데도 공감을 나타내면서 12월 FOMC에서 기준금리 인상이 이뤄질 가능성이 한층 높아졌다는 평가
- 특히 일부 정책위원들은 "다음 회의에서 반드시 금리 인상이 이뤄져야 한다"고 주장
- 고용시장이 호조를 이어가기 위해서는 금리 인상 속도를 점진적으로 유지해야 한다는 의견
- 물가가 예상보다 개선된 것은 긍정적인 상황이라고 진단했지만 몇 명의 위원들은 일시적인 요인 때문이

라고 진단하며 물가 상승률에 대한 의견은 엇갈림

* 내구재 주문, 1년 만에 가장 큰 폭 상승... 기업 투자가 되살아날 것이란 기대감 확산
  - 10월 내구재 주문 4.8% 증가 (전망치인 1.7%를 크게 웃도는 수준)

* 신규 주택판매, 예상을 깨고 다소 큰 폭으로 감소... 부동산 경기 침체 신호라기보다는 계절적 요인에 따른 일시적 현상이라는 평가가 지배적
  - 10월 신규 주택판매 전월 대비 1.9% 감소한 56만3000건 (예상치 59만건에 못 미치는 수준)

* 소비자 심리, 트럼프 정부의 경기 부양책에 대한 기대감으로 크게 개선
  - 11월 소비자심리지수 93.8 기록 (예비치 91.6은 물론 전월 87.2 웃도는 수준)

* 11월 美 제조업 PMI 예비치, 2015년 10월 이후 최고치인 53.9 기록

* <유럽 마감> 지표 호조에도 불구 사흘 만에 하락 마감... 프랑스와 이탈리아의 정치 불안과 영국의 내년 경제성장률이 낮아질 것이란 전망이 투자심리에 악영향
  - 국민투표를 앞둔 이탈리아에 대한 우려가 커졌고 비록 부결되긴 했지만 프랑수아 올랑드 프랑스 대통령에 대한 탄핵안이 하원에서 논의

* <상하이 마감> 차익 실현 매물 등에 밀려 반락 마감...시장 활성화와 정책에 대한 기대감으로 지수가 소폭 반등하기도 했지만 결국 장 막판에 전날 종가치 밑으로 하락

* <도쿄 마감> 근로감사의 날로 금융시장 휴장

DOW30	19083.18	(+0.31%)
NASDAQ	5380.68	(-0.11%)
S&P500	2204.72	(+0.08%)
NIKKEI225	18162.94	(휴장)
SHANGHAI	3241.14	(-0.22%)
FTSE100	6817.71	(-0.03%)
DAX30	10662.44	(-0.48%)
CAC40	4529.21	(-0.42%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 내구재 수주 등 경제지표 호조에 상승
  달러 인덱스, 전날보다 0.64% 상승한 101.65를 기록... 한 때 101.91까지 상승하며 2003년 3월 이후 13년8개월 만에 최고치

  달러-위안, 역외 시장에서 6.9205위안에 거래되며 위안화 가치는 역외에서 2010년 위안화가 거래를 시작한 이후 최저치

유로/달러 1.0552 (-0.0071)
유로/엔 118.75 (+0.76)
달러/엔 112.51 (+1.47)
달러/위안 6.8904 (+0.0125)
파운드/달러 1.2438 (+0.0015)
NDF 1183.00 / 1184.00원...7.00원 상승

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 달러 강세와 미국의 원유 시추기 가동건수 증가 영향으로 하락... 미국의 원유 재고가 감소했다는 소식에 소폭 하락하는데 그침
  - 美 지난주 원유 재고량, 130만 배럴 감소 (예상치, 67만 배럴 증가)
* <국제 금값> 달러화가 미국 경제 지표 호조로 강세를 보인 데 따라 하락

WTI 47.96 (-0.2%)
COMEX금 1189.30 (-1.8%)

5. 전일 국내 지표

코스피 1987.95 (+0.23%)
코스닥 600.29 (-1.71%)
원/달러 1176.20 (+0.10)
KTB 109.25 (0.00)
LKTB 125.55 (+0.20)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리, 단기물과 장기물이 엇갈림. 단기물은 매도가 이어지면서 약세를 면치 못했지만, 채권시장의 전반적인 약세에도 장기물은 20년 이상 초장기물 매수가 유입되면서 금리 소폭 하락.

CD(91d) 1.4300% (+0.01bp)

[국고채]
1y 1.6500% (+2.40bp)
3y 1.7570% (+0.70bp)
5y 1.8900% (-0.70bp)
10y 2.1300% (-2.00bp)
20y 2.2100% (-2.70bp)
30y 2.2250% (-3.00bp)

50y 2.2120% (-3.00bp)

[통안채]

1y	1.6510% (+2.60bp)
2y	1.7600% (+1.10bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1Y	-17.85bp	(-0.35bp)
2Y	-25.00bp	(+0.15bp)
3Y	-19.20bp	(+0.30bp)
5Y	-23.50bp	(-0.80bp)
10Y	-30.25bp	(-1.00bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 커브 플래트닝. 10년물 이상의 현물매수가 나오면서 IRS도 장기물의 오퍼가 강했음. 단기물은 속절없이 무너지는 모습.
* CRS, 외은 페이가 강해 전반적으로 금리 상승.

*IRS 금리

1Y	1.4725% (+2.25bp)
2Y	1.5100% (+1.25bp)
3Y	1.5650% (+1.00bp)
5Y	1.6550% (-1.50bp)
7Y	1.7300% (-2.50bp)
10Y	1.8275% (-3.00bp)

1*2Y	3.75	(-1.00bp)
2*3Y	5.50	(-0.25bp)
2*5Y	14.50	(-2.75bp)
3*5Y	9.00	(-2.50bp)
5*7Y	7.50	(-1.00bp)
5*10Y	17.25	(-1.50bp)

*CRS 금리

1Y	0.9900% (+3.50bp)
2Y	0.9900% (+6.00bp)

3Y 1.0150% (+5.00bp)
5Y 1.0400% (+4.00bp)
7Y 1.0650% (+4.00bp)
10Y 1.0800% (+4.00bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* 유로존 11월 합성 PMI 예비치, 54.1로 11개월 만에 최고치를 기록
  - 지난 10월 기록한 53.3과 시장 예상치 53.4를 모두 웃도는 수준

* 프리츠커 美 상무장관 '中, 자국을 환율조작국으로 지정하고 자국산 제품에 대해 45% 관세를 매기겠다는 공약을 트럼프 정부가 이행할 경우 보복에 나서겠다'는 뜻 미국에 통보
  - '이는 미국 노동자들과 미국 산업에 타격을 가해 미국 경제에 악영향을 줄 수 있다' 언급

* 말레이시아 중앙은행, 예상대로 기준금리 3% 동결
  - 통화 완화 정도가 정책 스탠스에 부합하며, 현 정책 기조로 경제가 꾸준한 성장세를 보일 것이라고 예상
  - 시장 유동성이 풍부하다면서도 '자국 외환시장이 제대로 작동할 수 있도록 달러 유동성 공급을 지속하겠다'며 자국 통화 급락을 방어하기 위해 환시 개입을 이어가겠다는 의지 보임

* 아만도 데탕코 필리핀 중앙은행 총재 '페소 움직임이 과도할 경우 변동성을 줄이기 위해 주저하지 않고 시장에 참여하겠다'

[국내]

* 한은 금통위원들, '트럼프·유럽 리스크' 열공 모드

* 장외파생 '마진룰' 강화에 CCP 청산 1천조 돌파

* 단기물 금리 불안 언제까지...환율·FOMC·연말이슈 주목
- 단기물 매도가 속출하고 있지만 이를 받아줄 매수 주체가 없다는 점이 단기물 불안의 가장 큰 이유
- 통상 단기물이 약해지는 시기인 연말이 다가오는 것도 매수를 미루는 요인

* 기재부와 한은의 채권시장 대응...'누가누가 잘하나'
- 기재부, 국고채 물량을 시장 예상보다 크게 축소하는 쪽으로 대응해 지나친 약세 국면을 돌리는 데 힘을 보탰다는 긍정적인 평가
- 반면에 한은은 국고채 단순매입을 조막손 규모로 시행하는 등 소극적으로 나섰다는 야박한 평가

금일 예정 지표

미국 추수감사절 금융시장 휴장

[FOMC 11월 의사록]

독일-3분기 GDP(QoQ) (예상:0.2%, 이전:0.2%) / GDP(YoY) (예상:1.7%, 이전:1.5%)
-11월 Ifo 기업환경지수 (예상:110.5, 이전:110.5)
-12월 GfK 소비자신뢰지수 (예상:9.7, 이전:9.7)