

1.글로벌 채권

- * <뉴욕 채권> 국채가격, OPEC의 감산 합의에 따른 유가 상승과 경제지표 호조 영향으로 하락
- * 국채가격, 전일의 유가 급등과 지표 호조에 따른 매도 분위기가 이어지는 가운데 다음날 나오는 지난 11월 고용 호조에 대한 기대까지 가세해 하락 출발
 - 미 제조업과 건설도 순항 중인 것이 확인되자 국채가는 추가 하락
- * 국채가는 오후 들어 저점 매수세가 나와 추가 하락하지 못하고 낙폭을 소폭 만회
- * 물가 상승 우려로 일반 국채를 팔고, 물가연동국채(TIPS)를 매수하는 '물가 거래'가 활성화
 - 10년물 국채수익률은 장중에 2.485%까지 상승

[미국]

2y	1.15%	(+3.4bp)
5y	1.90%	(+6.1bp)
10y	2.45%	(+7.3bp)
30y	3.11%	(+7.7bp)

[기타 10Y물]

영국	1.49%	(+7.9bp)
독일	0.36%	(+9.2bp)
프랑스	0.81%	(+6.1bp)
이탈리아	2.05%	(+6.2bp)
스페인	1.61%	(+6.3bp)
그리스	6.40%	(-6.0bp)

2.글로벌 증시

- * <뉴욕 마감> 국제 유가 급등에도 불구하고 기술주 부진 여파로 혼조세
- * 경기지표 호조로 기준금리 인상 가능성이 높아지면서 금융 업종 지수는 1.66% 급등한 반면 계속되는 달러 강세에 수출이 어려워질 것이란 분석에 기술 업종 지수는 2.29% 급락
- * 美 제조업 경기지표가 5개월 만에 최고치를 기록하며 경기 회복 신호가 더 뚜렷해지고 있음을 재확인
 - ISM 11월 미국 제조업 PMI 예상치(52.5) 웃도는 53.2 집계...생산은 물론 신규 주문이 모두 증가했기 때문으로 풀이
- * 미국 주간 실업보험청구자수 2주째 증가... 5개월래 최대치
 - 1만7천명 증가한 26만8천명을 기록하며 조사치 25만명 상회

* <유럽 마감> 국제 유가 급등에도 불구하고 주말 이탈리아 국민투표에 대한 불안감 영향으로 일제히 하락
 - 이탈리아, 오는 4일 상원을 축소해 정치 비용을 줄이고 정치 효율성을 높이는 것을 골자로 한 개헌안에 대한 국민투표 진행

* <상하이 마감> 유가 급등과 제조업 지표의 호조에 힘입어 상승

중국 11월 공식 제조업 PMI, 2년 5개월래 최고치 기록

- 11월 PMI 51.7을 기록하며 예상치(51.0)와 전월치(51.2)를 모두 상회...10월 생산과 시장 수요가 모두 회복세를 나타내 기업의 구매 의사가 강해졌다는 분석

- 차이신 제조업 PMI는 예상치를 소폭 웃돈 50.9를 기록했지만 전월치(51.2)는 하회

* <도쿄 마감> 8년만에 이뤄진 석유수출국기구(OPEC)의 감산합의가 호재로 작용하면서 닛케이지수 종가 기준 연중 최고치 기록

오전 닛케이지수는 상승폭을 2% 이상 늘리기도 했지만 오후 들어서는 가파른 상승에 대한 경계감으로 차익실현이 늘면서 상승폭 다소 반납

DOW30	19191.93	(+0.36%)
NASDAQ	5251.11	(-1.36%)
S&P500	2191.08	(-0.35%)
NIKKEI225	18513.12	(+1.12%)
SHANGHAI	3273.31	(+0.72%)
FTSE100	6752.93	(-0.45%)
DAX30	10534.05	(-1.00%)
CAC40	4560.61	(-0.39%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 미 경제지표 호조에도 11월 고용지표 발표를 앞둔 차익실현 매도세와 유가 상승에 따른 원자재 통화 강세 영향으로 하락

유로/달러	1.0659	(+0.0063)
유로/엔	121.56	(+0.32)
달러/엔	114.02	(-0.39)
달러/위안	6.8958	(+0.0093)
파운드/달러	1.2592	(+0.0086)
NDF	1167.00 / 1168.00원...0.20원 하락	

4.글로벌 상품

* <국제 유가> OPEC)의 감산 합의 효과가 지속되며 급등세를 이어감

* <국제 금값> 국제유가가 급등하는 등 위험자산 선호 심리가 강해져 하락

WTI 51.06 (+3.3%)
COMEX금 1169.400 (-0.4%)

5. 전일 국내 지표

코스피 1983.75 (+0.01%)
코스닥 593.85 (-0.38%)
원/달러 1167.60 (-1.50)
KTB 109.30 (-0.02)
LKTb 124.85 (-0.52)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리, 대부분 상승 마감. 커브 스티프닝. OPEC 감산합의 소식 & 미국 채권금리 상승에 이번 주 들어 처음으로 약세를 보임. 호가가 얇아 장중 변동성이 일부 생기기도 했지만 분위기를 반전시킬 정도는 아니었음.

* 국채 선물, 장중 변동성이 제한된 채 약세를 보이다가 정부가 채권시장안정펀드를 재가동하겠다고 밝히면서 일부 숏커버가 유입되며 낙폭을 줄임.

CD(91d) 1.5300% (+0.01bp)

[국고채]

1y 1.6260% (-2.10bp)
3y 1.7250% (+0.30bp)
5y 1.9270% (+1.60bp)
10y 2.2000% (+5.00bp)
20y 2.2170% (+5.00bp)
30y 2.2100% (+5.50bp)
50y 2.2000% (+5.60bp)

[통안채]

1y 1.6260% (-1.90bp)
2y 1.7070% (-1.30bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1Y -11.10bp (+1.15bp)

2Y	-16.45bp	(+1.55bp)
3Y	-13.75bp	(+1.45bp)
5Y	-25.45bp	(+1.15bp)
10Y	-36.75bp	(-0.25bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 국채선물 약세로 상승 마감. 국채선물이 큰 약세를 보이면서 IRS 커브 스티프닝. 3년, 4년물 위주로 거래가 잦았음.

* CRS, 전일에 이어 금리 상승. 달러-원 환율의 하락이 영향이 다소 있어 보임.

*IRS 금리

1Y	1.5150%	(-0.75bp)
2Y	1.5425%	(+0.25bp)
3Y	1.5875%	(+1.75bp)
5Y	1.6725%	(+2.75bp)
7Y	1.7375%	(+3.00bp)
10Y	1.8325%	(+4.75bp)

1*2Y	2.75	(+1.00bp)
2*3Y	4.50	(+1.50bp)
2*5Y	13.00	(+2.50bp)
3*5Y	8.50	(+1.00bp)
5*7Y	6.50	(+0.25bp)
5*10Y	16.00	(+2.00bp)

*CRS 금리

1Y	1.0350%	(+3.00bp)
2Y	1.1200%	(+3.50bp)
3Y	1.1800%	(+5.50bp)
5Y	1.2400%	(+5.00bp)
7Y	1.2500%	(+5.00bp)
10Y	1.2450%	(+5.00bp)

9. 주요뉴스

[해외]

- * 로버트 카플란 델러스 연은 총재 "'가까운 미래에' 기준금리를 인상해야 한다"
 - 미국 경제와 관련해서는 소비가 강한 모습을 보인다며 미국의 경기 침체 가능성을 일축

- * 아베 일본 총리의 경제자문, 엔저 추세 심화될 것으로 전망
 - '도널드 트럼프 미국 대통령 당선인의 부양 정책이 일본 경제에도 파장을 미칠 것이라며 달러화 상승세가 계속돼 달러-엔 환율이 120엔을 웃돌 수 있다' 언급

- * BOJ 정책 심의 위원 '장단기 금리 조작부 양적 & 질적 금융완화 정책 하에서도 대규모 국채(JGB) 매입은 계속될 것'
 - 양과 금리 측면의 금융완화를 지속하는데 아무런 변화가 없다는 점을 재차 강조

- * 유로존 10월 실업률, 2009년 중순 이후 최저 수준 기록... 유로존의 완만한 경제 회복세가 강화될 것임을 시사
 - 10월 실업률 예상치(10.0%) 하회하는 9.8% 기록

- * OPEC 회원국 인도네시아, OPEC의 감산량 할당 수용을 거부해 회원국 지위 정지
 - OPEC, 인도네시아에 하루 3만7천배럴의 감산을 요구했지만 자국은 5천배럴의 감산밖에 수용할 수 없어 회원국 지위 일시 정지키로 했다고 밝혀

- * 中 인민은행, 기업의 역외 송금에 한도를 도입할 것... 중국 당국의 자본 통제 본격화 <사우스차이나모닝포스트>
 - 해외 대출을 할 경우 먼저 국가외환관리국(SAFE)에 등록해야 하며, 등록 기간은 최소 1년 이상이 필요... 대출 금액도 일정한 범위로 제한
 - 더불어 개인 간 해외대출 및 해외 대출을 목적으로 한 채무금융도 금지한다는 계획

[국내]

- * 정부, 채권시장안정펀드 재가동...10조 이상 확대
- * 채권시장 "채안펀드, 금리안정 의지...진행 여부 지켜봐야"

- * 금통위의 소수의견..."11·3대책에도 집값 오를 수 있다"

금일 예정 지표

[라엘 브레이너 연준 이사 연설]

[대니얼 타롤로 연준 이사 연설]

한국-3분기 GDP(QoQ) (이전:0.7%) / (YoY) (이전:2.7%)

영국-11월 건설 PMI (예상:52.2, 이전:52.6)

유로존-10월 PPI(YoY) (예상:-1.0%, 이전:-1.5%)

미국-11월 비농업고용 (예상:175K, 이전:161K)

-11월 실업률 (예상:4.9%, 이전:4.9%)
