

뉴욕증시 - 중국 경기·중동 불안 ...다우 1.58% 하락 마감

1. 中, 제조업 둔화 새해 첫 거래일 7% 폭락 ...서킷브레이커 마감 (-6.85%)

* 부진한 제조업 지표, 경기 둔화 우려 상승

...12월 Caixin제조업PMI 48.6 → 48.2 (예상:49.0) ...기준선 '50' 10개월 연속 하회

* 위안화 가치, 4년6개월래 최저 수준으로 평가절하 ...중국 내 자본유출 우려, 주가 폭락 부추겨

2. 중동, 사우디&이란 종파 갈등 속 국교 단절 사태

...국제 유가, 원유 공급 불확실성 증폭 불구 하락 반전 마감

3. 美 경기지표 부진

* 12월 제조업PMI 51.3 → 51.2 (예상:52.8) ...예상 하회

* 12월 ISM제조업PMI 48.6 → 48.2 (예상:49.0) ...2009년 6월 이후 최저치

* 11월 건설지출 (MoM) 1.0% → -0.4% (예상:0.6%) ...2014년 6월 이후 최초 감소 & 감소폭 최대

4. 샌프란연은 총재, 올해 GDP 2~2.25%·실업률 5% 이하 전망

...올해 3~5번 금리 인상 가능성...'中' 경제 우려 안해'

5. 유로존-12월 제조업PMI 53.1 → 53.2 (예상:53.1) ...기준선 '50' 30개월 연속 상회

6. 독일-12월 제조업PMI 53.0 → 53.2 (예상:53.0)

-12월 CPI (MoM) 0.1% → -0.1% (예상:0.2%) ...예상 하회

국제 증시			국제 상품		
DOW30	17148.94	(-1.58%)	WTI	36.76	(-0.8%)
NASDAQ	4903.09	(-2.08%)	COMEX금	1075.20	(+1.4%)
S&P500	2012.66	(-1.53%)	COMEX구리	2.0795	(-2.60%)
KOSPI	1918.76	(-2.17%)	주요국가 10y국채		
KOSDAQ	677.79	(-0.67%)	한국	2.039%	(-3.7bp)
국제 통화			미국	2.237%	(-3.8bp)
유로/달러	1.0828	(-0.0030)	영국	1.87%	(-8.3bp)
유로/엔	129.32	(-1.24)	독일	0.56%	(-)
달러/엔	119.42	(-0.78)	프랑스	0.94%	(-)
달러/위안	6.5032	(+0.0096)	이탈리아	1.55%	(-)
원/달러	1187.70	전일 1172.50	스페인	1.71%	(-)
NDF	1190.00 / 1190.50원	1.35원 상승	그리스	7.91%	(-)

금일 예정 지표			
국가	경제지표	Previous	Forecast
유로존	-12월 CPI (YoY)	0.2%	0.3%
독일	-12월 실업률	6.3%	6.3%

1.전일 장중 동향

*KTB : 시가 109.59 / 종가 109.74

*LKT : 시가 126.11 / 종가 126.62

1)채권시장은 지난해 롱 분위기를 이어가는 과정이지만 연초부터 중국 변수로 시장이 생각보다도 강하다보니 롱에 적극적으로 대응한 기관은 많지 않은 듯함. 시장참여자들이 적어도 매도 분위기는 아니라는 인식이 공고해졌을 것으로 보임.

-오후 들어 중국 증시 폭락이 아시아 증시 전반에 영향을 미치면서 채권시장은 강세 흐름을 이어감. 중국 증시는 제조업 지수가 시장 예상보다 부진한 것으로 나타난데다 중동지역 불안 확대까지 겹치면서 서킷브레이커가 발동됨. 아시아증시는 일제히 급락.

2)국채선물은 장 초반 보험권에서 눈치보기가 이어짐. 지난달 3년 국채선물을 대량으로 매수한 외인 흐름에 주목. 외인은 연초에도 3년 국채선물 매수를 이어감. 이들 매수에 국채선물은 상승폭을 늘림.

-장 막판 상승폭을 일부 되돌리며 마감. 3년 국채선물 고점과 종가의 차이는 2틱이며, 10년 국채선물은 고점 대비 20틱 밀린 47틱 상승 마감.

3)IRS 금리가 채권시장 강세에 연동해 하락. 중국 주식시장이 패닉 상태로 치달으면서 안전자산 선호 심리가 살아났고 IRS 금리에도 직접적인 영향을 줌. 새해 첫날임에도 거래가 많지는 않았음.

4)CRS 금리도 장기구간 위주로 큰 폭 하락. CRS도 딱히 물량이 많지는 않았지만, IRS 금리가 하락하면서 이를 따라간 측면이 있음. 연말에 나왔던 윈드드레싱 성격의 비드가 일부 되돌려진 부분도 있는 것으로 보임.

국내 주요 금리			BOND SWAP SPREAD		
3y	1.662%	(+0.7bp)	3y	-1.7bp	(+0.3bp)
5y	1.814%	(+0.9bp)	5y	-7.1bp	(+1.2bp)
10y	2.076%	(+0.6bp)	10y	-14.2bp	(+0.8bp)
CD	1.670%	(0)			

IRS OUTRIGHT			IRS SPREAD		
1Y	1.5900%	(-1.5bp)	1*2Y	-1.50	(-1.25bp)
2Y	1.5750%	(-3.25bp)	2*3Y	3.50	(0)
3Y	1.6100%	(-3.25bp)	2*5Y	12.75	(0)
5Y	1.7025%	(-3.25bp)	3*5Y	9.25	(0)
7Y	1.7800%	(-4.0bp)	5*7Y	7.75	(-0.75bp)
10Y	1.8825%	(-4.75bp)	5*10Y	18.00	(-1.5bp)