

뉴욕증시 - 유가 폭등, 日·EU 양적완화 기대감 ...다우 1.33% 상승 마감

- 1. 국제유가, 9% 폭등 배럴당 32달러 회복**
...美 동부 한파 예보 & 저가 매수세 & 美 원유시추기 가동건수 감소 호재
- 2. 日·EU 중앙은행 총재, 필요시 추가 양적완화**
* 유럽 증시, ECB 추가 경기부양 기대감에 큰 폭 올라
- 3. 애플, 5% 이상 급등세 나타내며 지수 견인**
...오는 9월 아이폰7 출시 전 주가 50%가량 급등세 가능성 진단
- 4. 美 경기지표 혼조**
* 12월 기존주택판매 4.76M → 5.46M (예상:5.20M) ...예상 상회
* 1월 제조업PMI 51.2 → 52.7 (예상:51.0) ...예상 상회
* 12월 CB선행지수 (MoM) 0.5% → -0.2% (예상:-0.1%) ...예상 하회
- 5. 유로존-1월 Markit종합PMI 54.3 → 53.5 (예상:54.2)**
-1월 제조업PMI 53.2 → 53.3 (예상:53.0)
-1월 서비스PMI 54.2 → 53.6 (예상:54.2)
- 6. S&P, 그리스 신용등급 'B-'로 상향 ...전망 '안정적'**

국제 증시			국제 상품		
DOW30	16093.51	(+1.33%)	WTI	32.19	(+9%)
NASDAQ	4591.18	(+2.66%)	COMEX금	1096.30	(-0.2%)
S&P500	1906.90	(+2.03%)	COMEX구리	2.0025	(+0.30%)
KOSPI	1879.43	(+2.11%)	주요국가 10y국채		
KOSDAQ	670.95	(+0.77%)	한국	2.037%	(+4.2bp)
국제 통화			미국	2.052%	(+3.1bp)
유로/달러	1.0796	(-0.0091)	영국	1.71%	(+4.0bp)
유로/엔	128.29	(+0.39)	독일	0.48%	(+3.4bp)
달러/엔	118.82	(+1.34)	프랑스	0.80%	(+2.4bp)
달러/위안	6.5572	(-0.0013)	이탈리아	1.57%	(+1.1bp)
원/달러	1200.10	전일 1213.70	스페인	1.72%	(+0.7bp)
NDF	1198.50 / 1199.50원	2.20원 하락	그리스	8.79%	(-76.0bp)

주간 예정 지표			
국가/날짜	경제지표	Previous	Forecast
1월 25일			
미국	-1월 달러스연은제조업지수	-20.1	-15.0
독일	-1월 Ifo기업환경지수	108.7	108.4
일본	-12월 무역수지	-380B	100B
[FOMC 1일차 (~27)]			
1월 26일 [ECB President Draghi Speaks]			
[BoE Gov Carney Speaks]			
	-1월 CB소비자신뢰지수	96.5	96.5
미국	-1월 서비스PMI	54.3	54.0
	-11월 S&P/CS 20대도시가격주택지수 (YoY)	5.5%	5.7%

1월 27일		[FOMC 2일차]	
미국	-12월 신규주택판매 (MoM)	4.3%	2.0%
독일	-2월 GfK소비자신뢰지수	9.4	9.3
1월 28일		[BOJ 통화정책회의 1일차 (~29일)]	
	-신규실업수당청구건수	293K	281K
미국	-12월 잠정주택판매 (MoM)	-0.9%	0.7%
	-12월 내구재주문 (MoM)	0.0%	-0.3%
	-12월 핵심내구재주문 (MoM)	-0.1%	-0.2%
유로존	-1월 소비자신뢰지수	-5.7	-6.0
영국	-4분기 GDP (QoQ)	0.4%	0.5%
독일	-1월 CPI (MoM)	-0.1%	-0.8%
1월 29일		[BOJ 통화정책회의 2일차]	
[FOMC Member Williams Speaks]			
	-4분기 GDP (QoQ)	2.0%	0.8%
미국	-1월 미시간대소비자신뢰지수	93.3	93.0
	-1월 시카고PMI	42.9	45.0
유로존	-1월 CPI (YoY)	0.2%	0.4%
영국	-1월 GfK소비자신뢰지수	2	1
일본	-12월 산업생산 (MoM)	-0.9%	-0.3%
	-12월 가계지출 (MoM)	-2.2%	2.0%
	-12월 실업률	3.3%	3.3%

1.전일 장중 동향

*KTB : 시가 109.74 / 종가 109.75

*LKT : 시가 126.88 / 종가 126.70

1)국고채 금리는 국고 3년 지표물 15-7호를 기준으로 0.8bp 상승한 1.615%에 출발. 국고 10년 지표물 15-8호는 1.0bp 오른 2.005%에 시작.

-ECB 총재가 오는 3월 통화정책을 재점검하겠다고 밝히면서 약세를 보인 미국채 금리 동향을 따라감. 10년 만기 미국채 금리는 전날보다 5.13bp 상승한 2.0320%를 나타냄.

-이후 국고채 금리는 일본 닛케이를 비롯해 홍콩, 중국 주가가 모두 오르자 상승폭을 확대함. 장 마감까지 이들 증시는 오름세를 지속했고 국내 채권금리는 이에 연동하며 약세 분위기가 이어짐.

2)10년 국채선물은 일본과 중국 등 아시아 증시 강세에 따른 위험자산 선호 심리로 낙폭을 확대후 장단기 구간에서 모두 하락 마감 .

3)IRS 금리가 상승. 아시아 증시의 급등세로 위험자산 선호 심리가 강화하면서 장지구간 금리가 상승 압력을 더 받음.

IRS 금리는 장중 하락하기도 했으나 오후 들어 일본 증시를 비롯한 아시아증시가 급등세를 타면서 상승 압력을 받음.

4)CRS 금리도 달러-원 환율 급락 속에 상승 흐름을 탐. CRS는 부채스와프 태핑 물량이 보이는 반면에 에셋스와프는 다소 소강 상태 보임.

국내 주요 금리			BOND SWAP SPREAD		
3y	1.621%	(+1.0bp)	3y	-2.6bp	(+1.0bp)
5y	1.760%	(+1.0bp)	5y	-8.5bp	(+1.3bp)
10y	2.037%	(+4.2bp)	10y	-19.2bp	(-0.7bp)
CD	1.670%	(0)			

IRS OUTRIGHT			IRS SPREAD		
1Y	1.5725%	(+0.25bp)	1*2Y	-1.25	(+1.0bp)
2Y	1.5600%	(+1.25bp)	2*3Y	3.50	(+0.75bp)
3Y	1.5950%	(+2.0bp)	2*5Y	11.50	(+1.0bp)
5Y	1.6750%	(+2.25bp)	3*5Y	8.00	(+0.25bp)
7Y	1.7450%	(+2.75bp)	5*7Y	7.00	(+0.5bp)
10Y	1.8450%	(+3.5bp)	5*10Y	17.00	(+1.25bp)