

뉴욕증시 - IT주 선전·국제유가 회복에 반등 ...다우 0.8% ↑

1. 페이스북 & 아마존 등 대형 IT주 선전 ...각 +15.52% & +8.91%
2. 국제유가, 감산 논의 발언에 7% 넘게 폭등 후 진정 ...33달러 회복 (+2.9%)
 - * 러시아 석유장관 "사우디, 지난 회의 원유 생산량 5% 감축안 제안"
 - * OPEC, 사우디 5% 감산 제안설 '사실무근'
3. 美 경기지표 혼조
 - * 신규실업수당청구건수 294K → 278K (예상:282K) ...고용시장 견조
 - * 12월 잠정주택판매 (MoM) -1.1% → 0.1% (예상:0.8%)
 - * 12월 내구재주문 (MoM) -0.5% → -5.1% (예상:-0.6%)
4. 유럽 증시, 유가 반등에도 불구하고 실적 부진 영향으로 일제히 하락
5. 인민은행, 공개시장조작 빈도 일시적으로 상향 ...1월29일~2월19일, 현행 주 2회 → 매일 시행
6. 유로존-1월 소비자신뢰지수 -5.7 → -6.0 (예상:-6.0)
 - 영국-4분기 GDP (QoQ) 0.4% → 0.5% (예상:0.5%)
 - 독일-1월 CPI (MoM) -0.1% → -0.8% (예상:-0.8%)

국제 증시			국제 상품		
DOW30	16069.64	(+0.79%)	WTI	33.22	(+2.9%)
NASDAQ	4506.68	(+0.86%)	COMEX금	1116.10	(-0.01%)
S&P500	1893.36	(+0.55%)	COMEX구리	2.0515	(-0.61%)
KOSPI	1906.94	(+0.48%)	주요 국가 10y국채		
KOSDAQ	681.29	(+0.89%)	한국	2.018%	(+0.5bp)
국제 통화			미국	1.984%	(-1.9bp)
유로/달러	1.0941	(+0.0051)	영국	1.67%	(-4.0bp)
유로/엔	130.02	(+0.82)	독일	0.40%	(-3.9bp)
달러/엔	118.83	(+0.20)	프랑스	0.73%	(-1.9bp)
달러/위안	6.5528	(-0.0005)	이탈리아	1.51%	(+1.5bp)
원/달러	1208.50	전일 1202.00	스페인	1.62%	(+0.6bp)
NDF	1208.00 / 1209.00원	1.10원 하락	그리스	9.18%	(+10.8bp)

금일 예정 지표			
국가	경제지표	Previous	Forecast
[BOJ 통화정책회의 2일차]			
[FOMC Member Williams Speaks]			
미국	-4분기 GDP (QoQ)	2.0%	0.8%
	-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 실업률	3.3%	3.3%

1. 전일 장중 동향

* KTB : 시가 109.80 / 증가 109.74

* LKTB : 시가 127.04 / 증가 126.88

1) 국고채 금리는 국고 3년 지표물 15-7호를 기준으로 전날보다 0.3bp 상승한 1.605%에 출발. 국고 10년 지표물 15-8호는 전날보다 0.5bp 오른 2.020%에 시작.

- 이달 FOMC에서 저유가와 세계 경제의 불확실성을 언급하긴 했지만, 오는 3월에 금리를 올리지 않을 것이라는 시장참가자들의 기대에는 못 미침.

-미국채 금리는 소폭 올랐고 우리나라도 이 동향을 따라감. 10년 만기 미국채 금리는 전날보다 0.69bp 상승해 2.0028%를 기록.

-이후 국고채 금리는 개장 초부터 외인의 선물 매도세가 강하게 출현함. 외인은 개장 10분 만에 KTB를 4천계약 이상 순매도. 오전 10시를 지나자 LKTB도 정리함. 국내 기관투자자들의 매수 심리가 위축.

-중국 상하이종합지수가 약보합권을 보였지만, 채권시장의 분위기를 바꾸진 못함. 코스피가 상승 마감했고 BOJ의 정책결정을 기다려 수급 변화가 크지 않음.

-외인이 장 후반 LKTB를 순매수로 전환하면서 장기물의 금리 상승폭이 줄어듦. 국채선물은 장단기 구간에서 모두 하락.

2) IRS 금리는 채권시장 약세에 연동해 장중 내내 상승 압력을 받긴 하였으나 외인의 10년선물 매수 등의 영향으로 뒤쪽구간은 오퍼가 꾸준히 유입. 커브는 소폭 누는 모습임.

3) CRS 금리는 상승. 커브 흐름도 IRS를 따라가면서 중기구간 이후로 플래트닝 흐름이 나타남.

-CRS 단기구간에 에셋스와프 물량이 많이 나왔음에도 FX스와프가 오르면서 CRS 금리도 상승 압력을 받았음. 커브 흐름은 전반적으로 IRS를 따라가는 모습이 나옴.

국내 주요 금리			BOND SWAP SPREAD		
3y	1.618%	(+1.4bp)	3y	-2.8bp	(+0.1bp)
5y	1.756%	(+1.2bp)	5y	-8.6bp	(-0.2bp)
10y	2.018%	(+0.5bp)	10y	-18.3bp	(+0.3bp)
CD	1.650%	(0)			

IRS OUTRIGHT			IRS SPREAD		
1Y	1.5700%	(+0.75bp)	1*2Y	-1.00	(+0.75bp)
2Y	1.5600%	(+1.5bp)	2*3Y	3.00	(0)
3Y	1.5900%	(+1.5bp)	2*5Y	11.00	(-0.5bp)
5Y	1.6700%	(+1.0bp)	3*5Y	8.00	(-0.5bp)
7Y	1.7375%	(+0.75bp)	5*7Y	6.75	(0)
10Y	1.8350%	(+0.75bp)	5*10Y	16.50	(0bp)