

뉴욕증시 - 헬스케어·IT 부진에 이틀째 ↓ ...다우 0.32% ↓

1. 최근 기업들 실적 실망 ...헬스케어업종 -1.4% & 기술업종 -0.9%
2. 카플란 델러스연은 총재 "물가·고용 목표 도달 진전, 금리인상 주장할 것"
3. 美 경기지표 부진
 - * 3월 개인소비 (MoM) 0.1% → 0.1% (예상:0.2%)
 - * 3월 근원PCE물가지수 (MoM) 0.2% → 0.1% (예상:0.1%)
 - * 4월 미시간대소비자신뢰지수 91.0 → 89.0 (예상:90.0)
 - * 4월 시카고PMI 53.6 → 50.4 (예상:53.0)
4. 유럽증시, 나홀 만에 ↓ ...은행주 부진 + 실적 실망감
 - ...이탈리아 부실은행 구제기금, 첫 유상증자 참여 결과 부진
5. S&P, 영국 신용등급 'AAA' 확인 ..전망 '부정적'
6. 美 재무부, 중국·일본·한국·독일·대만 5개국 환율 감시 대상 포함

국제 증시			국제 상품		
DOW30	17773.64	(-0.32%)	WTI	45.92	(-0.2%)
NASDAQ	4775.36	(-0.62%)	COMEX금	1290.50	(+1.9%)
S&P500	2065.30	(-0.51%)	COMEX구리	2.2790	(+0.64%)
KOSPI	1994.15	(-0.34%)	주요국가 10y국채		
KOSDAQ	699.77	(+0.01%)	한국	1.794%	(-0.7bp)
국제 통화			미국	1.83%	(+0.9bp)
유로/달러	1.1447	(+0.0100)	영국	1.59%	(-1.2bp)
유로/엔	121.94	(-0.74)	독일	0.27%	(+1.5bp)
달러/엔	108.08	(-1.63)	프랑스	0.63%	(+3.0bp)
달러/위안	6.4589	(-0.0365)	이탈리아	1.48%	(+0.5bp)
원/달러	1139.30	전일 1138.20	스페인	1.59%	(-1.0bp)
NDF	1144.00 / 1145.00원	4.65원 상승	그리스	8.25%	(-30.5bp)

주간 예정 지표			
국가/날짜	경제지표	Previous	Forecast
5월 2일 [중국(노동절), 영국(뱅크홀리데이) 휴장]			
미국	-4월 ISM제조업PMI	51.8	51.4
	-4월 제조업PMI	50.8	51.0
유로존	-4월 제조업PMI	51.5	51.5
독일	-4월 제조업PMI	51.9	51.9
5월 3일 [일본(헌법기념일) 휴장]			
중국	-4월 Caixin제조업PMI	49.7	49.9
유로존	-3월 PPI (MoM)	-0.7%	-0.1%
영국	-4월 제조업PMI	51.0	51.2
5월 4일 [일본(초록의 날) 휴장]			
미국	-4월 ADP비농업고용변동	200K	195K
	-1분기 비농업생산성	-2.2%	-1.3%
	-3월 무역수지	-47.10B	-41.50B
	-1분기 단위노동비용	3.3%	3.0%
	-4월 ISM비제조업PMI	54.5	54.7

	-4월 서비스PMI	52.1	52.1
	-3월 공장주문	-1.7%	0.6%
유로존	-4월 Markit종합PMI	53.0	53.0
	-4월 서비스PMI	53.2	53.2
	-3월 소매판매 (MoM)	0.2%	-0.1%
독일	-4월 종합PMI	53.8	53.8
	-4월 서비스PMI	54.6	54.6
5월 5일 [한국,일본(어린이날) 휴장]			
미국	-신규실업수당청구건수	257K	261K
중국	-4월 Caixin서비스PMI	52.2	52.6
영국	-4월 서비스PMI	53.7	53.5
5월 6일 [한국(임시공휴일) 휴장]			
	-4월 실업률	5.0%	5.0%
미국	-4월 비농업고용	215K	200K
	-3월 소비자신용	17.22B	16.00B
5월 7일			
	-4월 무역수지	29.86B	
중국	-4월 수출액 (YoY)	11.5%	
	-4월 수입액 (YoY)	-7.6%	

1.전일 장중 동향

*KTB : 시가 110.39 / 종가 110.34

*LKT : 시가 129.45 / 종가 129.36

1)국고채 금리는 국고3년 지표물인 15-7호를 기준으로 전 거래일 대비 1.1bp 하락한 1.443%에 거래를 시작. 이후 상승해 1.453%에 장을 마감.

-국고채 금리는 하락 출발했으나 오전 중 한은의 양적완화 반대발언 루머로 그 폭이 줄어들었음. 국채선물은 강세 출발해 그 폭이 다소 줄었음.

-한은 부총재보는 이날 통화신용정책 보고서 설명회에서 "선별적 양적완화나 한국판 양적완화나 일반적으로 중앙은행 사람들이 생각하는 양적완화와는 차이가 있다"

"최근의 그런 논의는 기업 구조조정을 지원하기 위한 국채은행 자본확충 쪽으로 투영돼 콘셉트가 좀 중첩되는 측면도 있다"고 말함.

2)CRS 금리가 대부분 구간에서 하락. 단기 FX 스왑 금리가 하락한 영향을 받았음. 단기 FX 스왑 금리가 빠지면서 CRS 금리도 연동돼 하락. 에셋 물량도 다소 있었음.

3)IRS는 반면 조용한 움직임을 보임. 거래량이 적은 가운데 국채선물 움직임에 연동되면서 장기 구간이 소폭 낮아짐.

-장기쪽 금리가 소폭 빠졌지만 유의미한 수준은 아니었고, 위아래가 꽤 막혀있어서 움직일만한 여유가 적어 보임.

국내 주요 금리			BOND SWAP SPREAD		
3y	1.453%	(+0.3bp)	3y	-2.4bp	(-0.4bp)
5y	1.550%	(-0.2bp)	5y	-6.0bp	(-0.1bp)
10y	1.794%	(-0.7bp)	10y	-16.1bp	(+0.1bp)
CD	1.610%	(0)			

IRS OUTRIGHT			IRS SPREAD		
1Y	1.4625%	(0)	1*2Y	-5.00	(0)
2Y	1.4125%	(0)	2*3Y	1.75	(0)
3Y	1.4300%	(0)	2*5Y	7.75	(-0.25bp)
5Y	1.4900%	(-0.25bp)	3*5Y	6.00	(-0.25bp)
7Y	1.5475%	(-0.25bp)	5*7Y	5.75	(0)
10Y	1.6375%	(-0.25bp)	5*10Y	14.75	(0)