

1.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 엇갈린 실적·경기지표, 차익실현에 하락...다우 0.42% ↓

- 사상 최고치 행진에 따른 차익실현 매물

- 인텔 4% 하락

- 퀄컴 & 바이오젠, 7.4% & 7.6% 상승

-美 경제지표 혼조

신규실업수당청구건수 254K → 253K (예상:265K)...30만건 72주 연속 하회

6월 기존주택판매(MoM) 1.5% → 1.1% (예상:-0.5%)...9년 4개월 만에 최고치

7월 필라델피아연은제조업지수 4.7 → -2.9 (예상:5.0)...예상 하회

* <유럽 마감> ECB 실망감 '혼조'... 獨만 소폭 상승

* <상하이 마감> 외국인 자금 유입 기대...0.37% ↑

* <도쿄 마감> 정부 부양책 기대로 상승...0.77% ↑

DOW30 18517.23 (-0.42%)...

NASDAQ 5073.90 (-0.31%)

S&P500 2165.17 (-0.36%)

NIKKEI225 16810.22 (+0.77%)

SHANGHAI 3039.01 (+0.37%)

FTSE100 6699.89 (-0.43%)

DAX30 10156.21 (+0.14%)

CAC40 4376.25 (-0.08%)

2.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가, ECB 신중함 속 저점매수에 상승

[미국]

2y 0.68% (-3.2bp)

10y 1.56% (-2.4bp)

30y 2.29% (-0.7bp)

[기타 10Y물]

영국 0.83% (-0.1bp)

독일 -0.02% (-0.6bp)

프랑스 0.21% (-0.5bp)

이탈리아 1.24% (+0.3bp)

스페인 1.12% (-3.5bp)

그리스 7.81% (+4.6bp)

3.글로벌 환시

* 달러, 일본 헬리콥터 머니 가능성 약화에 하락

* 日 엔화 가치, 구로다 총재 발언 영향 1% 가까이 급등

...'헬리콥터 머니' 실현 가능성 전면 부인

유로/달러 1.1024 (+0.0011)

유로/엔 116.59 (-1.09)

달러/엔 105.77 (-1.10)

달러/위안 6.6872 (-0.0074)

파운드/달러 1.32318 (+0.00246)

NDF 1138.50 / 1139.50원...2.75원 상승

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 美 휘발유 재고 등 증가 우려로 2.2% 하락

* <국제 금값> ECB 추가 양적완화 시사에 0.9% 상승

WTI 44.75 (-2.2%)

COMEX금 1331.00 (+0.90%)

5. 전일 국내 지표

코스피 2012.22 (-0.16%)

코스닥 708.12 (+0.44%)

원/달러 1135.90, 전일비 -5.1원

*KTB: 111.06, 전일비 -5틱

*LKTb: 133.08, 전일비 -26틱

6. 전일 국내 주요 금리: 외인의 3년, 10년 국채선물 순매도에 따라 금리 상승. 채권 시장 참여자들은 우선 ECB 기준금리 동결 전망에 드라기 총재의 발언에 따라 시장의 스탠스가 바뀔 것이라고 판단. G20 재무장관회의 등 이벤트 결과 및 FOMC 전까지는 외인의 매매동향에 따라 시장이 바뀔것으로 전망.

3y 1.233% (+1.2bp)

5y 1.264% (+1.7bp)

10y 1.439% (+2.1bp)

CD 1.360% (0bp)

7. 본드-스왑 스프레드

3y -2.1bp (+0.1bp)

5y -3.2bp (+0.3bp)

10y -14.7bp (-0.1bp)

8. IRS/CRS 동향: IRS 금리는 상승 마감. 주로 5년과 2/5년물 위주로 시장 거래가 이루어졌고, 변동성 자체는 크지 않았으나 거래는 원활한 모습. 2/5, 3/5년 등 5년물 스프레드 위주로 스티프닝

이 진행되었고, IRS 시장 역시 대외 이벤트 결과에 대한 관망세가 지속.

*IRS 금리

1Y	1.2525%	(+0.50bp)
2Y	1.2150%	(+1.00bp)
3Y	1.2125%	(+1.25bp)
5Y	1.2300%	(+1.75bp)
7Y	1.2450%	(+2.00bp)
10Y	1.2925%	(+2.00bp)

1*2Y	-3.75	(+0.50bp)
2*3Y	-0.25	(+0.25bp)
2*5Y	1.50	(+0.75bp)
3*5Y	1.75	(+0.50bp)
5*7Y	1.50	(+0.25bp)
5*10Y	6.25	(+0.25bp)

[해외]

* ECB, 예상대로 기준금리 사상 최저 수준 동결

- 기준금리인 '레피(Refi)' 금리를 제로(0)%로 유지.
- 주요 금리들이 장기간 현재 수준이나 현재보다 낮은 수준으로 유지될 것.
- 800억 유로 규모의 월간 채권 매입 내년 3월까지 지속...필요시 연장

* dragged, 필요하면 모든 가능한 정책 단행할 준비돼

- 경제 성장 전망 위험 여전히 하방으로 기울어
- 양적완화·목표물장기대출 프로그램 꽤 성공적
- "테이퍼링(점진적 QE 축소) 논의한 적 없다"

* 구로다 지난달 "헬리콥터 머니 필요 없다" 발언

- "필요가 없으며, 가능성도 없다"
- 헬리콥터 머니와 같은 공조 대신에 정부와 중앙은행이 재정과 통화정책을 각각 시행해야 한다는 기존의 태도를 되풀이.
- 만일 필요하다면 중앙은행의 현 정책을 되풀이할 것.

* IMF, G20 성장 둔화에 적극적 행동 촉구

- G20 브렉시트 위협에 적극적으로 나설 준비 갖춰야.
- 연준 세계 디스인플레이션으로 매우 점진 인상.

* S&P, 영국 기업들 대출에 소극적 변화

[국내]

<국내>

* 은행채 순발행액 감소세 지속...풍부한 예수금

* 20일 기준 무역수지 19억달러 흑자...수출 2%↓

- 21일 관세청에 따르면 이달 20일까지 통관기준 수출은 246억4천만달러, 수입은 227억7천500만 달러로 무역수지는 18억6천500만달러 흑자를 나타냄

- 수출은 작년 같은 기간에 비해 1.9% 줄고, 수입은 7.3% 감소

* 카드 금리 얼마나 덜 내렸나...조달금리 비교하니 '게걸음'

* 與 혁신위 "환율 하락 속도 빨라"...국제금융 강화 주문

금일 예정 지표

미국-7월 제조업PMI (이전:51.3, 예상:51.6)

유로존-7월 Markit종합PMI (이전:53.1, 예상:52.5)

-7월 제조업PMI (이전:52.8, 예상:52.0)

-7월 서비스PMI (이전:52.8, 예상:52.3)

독일-7월 종합PMI (이전:54.4, 예상:53.7)

-7월 제조업PMI (이전:54.5, 예상:53.5)

-7월 서비스PMI (이전:53.7, 예상:53.2)

일본-7월 제조업PMI (이전:48.1, 예상:48.3)