

<IPS 외국환중개 2016년 7월 25일 시황>

[http://www.ipscorp.co.kr/24\\_IrProducts.asp](http://www.ipscorp.co.kr/24_IrProducts.asp)

## 1.글로벌 증시

\* <뉴욕 마감> 통신·유틸리티 '선전'...S&P '역대 최고치'

- 버라이즌, 야후의 주요 사업부문 인수전에서 유력한 인수 후보 거론 소식에 1.3% 넘게 상승. 야후 주가도 1.3% 상승.

- AT&T, 2분기 매출과 순익 증가로 1.4% 상승.

-美 경제지표 호조

7월 제조업PMI 51.3 → 52.9 (예상:51.6)...9개월 만에 최고치 경신

\* <유럽 마감> 경기지표 부진·경기 부양 기대감에 '혼조'

7월 서비스PMI 52.8 → 52.7 (예상:52.3)...브렉시트 여파로 18개월 최저치

\* <상하이 마감> 차익실현 압력에 하락...0.86%↓

\* <도쿄 마감> 구로다發 엔고 여파로 하락...1.09%↓

DOW30 18750.85 (+0.29%)

NASDAQ 5100.16 (+0.52%)

S&P500 2175.03 (+0.46%)...이틀 만에 역대 최고치

NIKKEI225 16627.25 (-1.09%)

SHANGHAI 3012.82 (-0.86%)

---

|         |          |          |
|---------|----------|----------|
| FTSE100 | 6730.48  | (+0.46%) |
| DAX30   | 10147.46 | (-0.09%) |
| CAC40   | 4381.10  | (+0.11%) |

## 2.글로벌 채권

\* <뉴욕 채권> 국채가, 연준 기준금리 인상 우려로 하락

### [미국]

|     |       |          |
|-----|-------|----------|
| 2y  | 0.70% | (+2.5bp) |
| 10y | 1.57% | (+1.0bp) |
| 30y | 2.28% | (-0.8bp) |

### [기타 10Y물]

|      |        |          |
|------|--------|----------|
| 영국   | 0.80%  | (-3.6bp) |
| 독일   | -0.03% | (-1.4bp) |
| 프랑스  | 0.21%  | (-0.9bp) |
| 이탈리아 | 1.23%  | (-1.0bp) |
| 스페인  | 1.11%  | (-0.7bp) |
| 그리스  | 7.82%  | (+1.2bp) |

## 3.글로벌 환시

---

\* 달러, 9월 기준금리 인상 시사 기대에 상승

|        |                              |            |
|--------|------------------------------|------------|
| 유로/달러  | 1.0973                       | (-0.0051)  |
| 유로/엔   | 116.57                       | (-0.02)    |
| 달러/엔   | 106.17                       | (+0.40)    |
| 달러/위안  | 6.6669                       | (-0.0203)  |
| 파운드/달러 | 1.31080                      | (-0.01238) |
| NDF    | 1135.50 / 1136.00...1.05원 상승 |            |

#### 4.글로벌 상품

\* <국제 유가> 휘발유 등 재고 우려에 1.3% 하락

\* <국제 금값> 이익실현 매물에 0.6% 하락

|        |         |          |
|--------|---------|----------|
| WTI    | 44.19   | (-1.30%) |
| COMEX금 | 1323.40 | (-0.60%) |

#### 5. 전일 국내 지표

---

코스피 2010.34 (-0.09%)

코스닥 707.54 (-0.08%)

원/달러 1134.40, 전일비 -1.5원

\*KTB: 111.09, 전일비 +3틱

\*LKTb: 133.34, 전일비 +26틱

6. 전일 국내 주요 금리: 시장참가자들은 금주 있을 대외 이벤트 관망세. 미 FOMC, BOJ 통화정책 회의 등 시장에 큰 영향을 줄 수 있는 이벤트들이 대기하고 있어 이에 대한 확인이 필요하다는 분위기가 우세. 한국장은 외국인 매수에 강세 마감하였으며, 당분간은 강세 흐름이 지속될 것으로 보임.

3y 1.227% (-0.6bp)

5y 1.252% (-1.2bp)

10y 1.418% (-2.1bp)

CD 1.360% (0bp)

#### 7. 본드-스왑 스프레드

3y -2.0bp (+0.1bp)

5y -3.2bp (+0.2bp)

10y -13.6bp (+1.1bp)

8. IRS/CRS 동향: IRS 금리는 채권 시장과 연동하여 하락 마감. 채권 시장과 같이 대외 이벤트 확인이 필요하다는 시장참가자들의 분위기 속에 주로 단기물 위주로 거래가 이루어짐. 향후 대외

---

이벤트 결과에 따라 시장 방향성이 결정될 전망.

\*IRS 금리

1Y 1.2500% (-0.25bp)

2Y 1.2125% (-0.25bp)

3Y 1.2075% (-0.50bp)

5Y 1.2200% (-1.00bp)

7Y 1.2375% (-0.75bp)

10Y 1.2825% (-1.00bp)

1\*2Y -3.75 (0bp)

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 (0bp)

## 9. 주요뉴스

[해외]

\* G20 "거시정책 총동원 공조...재정정책 중요" 공동선언

---

- 영국의 유럽연합 탈퇴 등에 따른 세계 경제에 대한 부정적 영향을 막기 위해 가용한 거시정책을 총동원해 공조하기로 합의.

- 재정정책이 통화정책만큼 중요하다고 강조.

\* 브렉시트, 유로존 성장 전망 낮춰 <ECB 설문>

- 2017년 유로존 경제 성장률 전망치, 전분기 조사치보다 0.2%포인트 낮은 1.4%

- 2018년 성장률 예상치도 전분기대비 0.1%포인트 하락한 1.6%

- 올해 성장률 전망치는 1.5% 그대로 유지.

- 응답자 51명 중 28명이 이번 성장률 전망치에 브렉시트의 악영향이 있을 것으로 추정.

\* BOE, 영국 경기 극적 '하강' 통화완화 명분 커져

\* S&P, 그리스 신용등급 'B-'로 유지...전망 '안정적'

<국내>

\* 한중 재무장관 "보호무역주의 대응에 공조"(재송)

\* 금융研 "신흥국, 달러표시 부채 부담 가중"

\* <추경안>

- <추경안> 추경 11조 포함 28조+α 재정투입

- <추경안> 함정 등 61척 1.4조 발주...조선업 지원 '올인'

- <추경안> 산은·수은 구조조정 '실탄' 1.4조 투입

---

- <추경안> 환시 개입여력 확대...외평기금 5천억 확충
- <추경안> 17년만에 국채상환 추경...1.2조 배정

**\*\*주간 예정 지표\*\***

7월 25일

미국-7월 달러스런은제조업지수 (이전:-18.3)

독일-7월 Ifo기업환경지수 (이전:108.7, 예상:107.5)

7월 26일

[美 FOMC 1일차 (~26)]

미국-6월 신규주택판매(MoM) (이전:-6.0%, 예상:1.6%)

-7월 CB소비자신뢰지수 (이전:98.0, 예상:95.8)

-7월 서비스PMI (이전:51.4, 예상:52.0)

-5월 S&P/CS 20대도시주택가격지수(YoY) (이전:5.4%, 예상:5.6%)

한국-2분기 GDP(YoY, QoQ)

7월 27일

[美 FOMC 2일차]

미국-6월 잠정주택판매(MoM) (이전:-3.7%, 예상:1.8%)

-6월 내구재주문(MoM) (이전:-2.3%, 예상:-1.1%)

-6월 근원내구재주문(MoM) (이전:-0.3%, 예상:0.3%)

영국-2분기 GDP(QoQ) (이전:0.4%, 예상:0.5%)

독일-8월 GfK소비자신뢰지수 (이전:10.1, 예상:9.9)

한국-7월 한국 소비자신뢰지수(이전:0.5%, 예상:0.7%)

7월 28일

[BOJ 통화정책회의 1일차]

미국-신규실업수당청구건수 (이전:253K, 예상:261K)

유로존-7월 소비자신뢰지수 (이전:-7.3, 예상:-8.0)

독일-7월 실업률 (이전:6.1%, 예상:6.1%)

-7월 CPI(MoM) (이전:0.1%, 예상:0.2%)

7월 29일

[BOJ 통화정책회의 2일차]

---

미국-2분기 GDP(QoQ) (이전:1.1%, 예상:2.6%)

-7월 미시간대소비자신뢰지수 (이전:89.5, 예상:90.5)

-7월 시카고PMI (이전:56.8, 예상:54.1)

유로존-GDP(QoQ) (이전:0.6%, 예상:0.3%)

-7월 CPI(YoY) (이전:0.1%, 예상:0.1%)

-7월 근원CPI(YoY) (이전:0.9%, 예상:0.9%)

-6월 실업률 (이전:10.1%, 예상:10.1%)

한국-8월 제조업 기업경기실사지수

-6월 한국 산업생산(YoY) (이전:4.3%, 예상:0.2%)

-6월 한국 산업생산(MoM) (이전:2.5%, 예상:-0.6%)

-한국 소매판매(MoM) (이전:0.6%)

-한국 서비스부문 산출 (MoM) (이전:0.1%)

---