

1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가, GDP 큰 폭 부진에 상승

- 일본은행이 실망스러운 통화 완화책을 내놓아 안전자산 선호가 강해진 데다 2분기 GDP 등 경제지표가 시장 기대에 못 미치면서 상승.

- BOJ, 금융정책결정회의를 열고 상장지수펀드(ETF) 매입 규모를 6조엔으로 늘렸지만, 정책금리는 마이너스(-) 0.1%로 동결.

[미국]

2y 0.66% (-5.1bp)

10y 1.45% (-5.1bp)

30y 2.18% (-4.9bp)

[기타 10Y물]

영국 0.68% (-2.8bp)

독일 -0.12% (-3.0bp)

프랑스 0.10% (-2.8bp)

이탈리아 1.16% (-3.0bp)

스페인 1.01% (-7.0bp)

그리스 7.98% (+7.8bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 2Q GDP성장률 예상↓·실적↑...혼조세

- 전날 장마감 후, 알파벳과 아마존이 기대 웃도는 실적 발표

-美 경제지표 부진...미 성장 부진 확인, 기준금리 인상 기대 후퇴

2분기 GDP(QoQ) 1.1% → 1.2% (예상:2.6%)

7월 미시간대소비자신뢰지수 89.5 → 90 (예상:90.5)

7월 시카고PMI 56.8 → 55.8 (예상:54.0)

* <유럽 마감> 기업실적 개선에 반등 성공

- 은행주들이 실적 결과를 바탕으로 은행주들이 스트레스테스트를 앞두고 상승세를 펼친 것이 호재

* <상하이 마감> 규제 우려에 투자심리 위축...0.5%↓

* <도쿄 마감> 일본은행 ETF 매입 확대로 상승...0.56%↑

- ETF 매입 규모, 연 3조3천억엔 → 6조엔

DOW30 18432.24 (-0.13%)...

NASDAQ 5162.13 (+0.14%)

S&P500 2173.60 (+0.16%)

NIKKEI225 16569.27 (+0.56%)

SHANGHAI 2979.34 (-0.50%)

FTSE100 6724.43 (+0.05%)

DAX30 10337.50 (+0.61%)

CAC40 4439.81 (+0.44%)

3.글로벌 환시

* 달러, 연준 금리 인상 기대 후퇴에 급락

* BOJ, ETF 매입만 확대...시장 실망에 엔화 급등

유로/달러 1.1171 (+0.0097)

유로/엔 114.09 (-2.48)

달러/엔 102.06 (-3.21)

달러/위안 6.6511 (-0.0086)

파운드/달러 1.32286 (+0.00678)

NDF 1113.50 / 1114.00원...6.70원 하락

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 저가 매수세 유입 등에 1.1% 상승

* <국제 금값> 달러 약세 등에 1.2% 상승

WTI 41.60 (+1.10%)

COMEX금 1357.50 (+1.20%)

5. 전일 국내 지표

코스피 2016.19 (-0.24%)

코스닥 706.24 (+0.35%)

원/달러 1120.20 전일비 -4.20원

*KTB: 111.14, 전일비 -4틱

*LKTb: 133.70, 전일비 -33틱

6. 전일 국내 주요 금리: 국채 시장은 BOJ 통화정책 실망감에 금리가 상승, 외인은 사상 최대 규모의 10년 국채선물 순매도. 주말동안 발표된 미 경제지표에 따라 시장 방향성이 결정될 전망.

3y 1.216% (+1.3bp)

5y 1.235% (+1.8bp)

10y 1.386% (+2.9bp)

CD 1.360% (0bp)

7. 본드-스왑 스프레드

3y -0.9bp (+2.2bp)

5y -2.5bp (+2.5bp)

10y -12.0bp (+2.5bp)

8. IRS/CRS 동향: 국채선물과 함께 강세 출발했던 시장은 BOJ 실망감 및 외인 순매도에 따라 금리가 큰 폭으로 상승, 커브 역시 스티프닝이 이루어짐. 미 경제지표 발표에 따라 시장이 어떤 반응을 보일지 시장참가자들의 이목이 집중될 것으로 보임.

*IRS 금리

1Y	1.2400%	(+0.25bp)
2Y	1.1950%	(+1.00bp)
3Y	1.1950%	(+2.25bp)
5Y	1.1975%	(+3.00bp)
7Y	1.2050%	(+3.00bp)
10Y	1.2425%	(+3.00bp)
1*2Y	-4.50	(+0.75bp)
2*3Y	0.00	(+1.25bp)
2*5Y	0.25	(+2.00bp)
3*5Y	0.25	(+0.75bp)
5*7Y	0.75	(0bp)
5*10Y	4.50	(0bp)

9. 주요뉴스

[해외]

- * 윌리엄스 샌프란시스코연은 총재, 경제 기준금리 인상 지지할 것
- * 카플란 델러스 연은 총재 "미 경제성장, 역사적 기준에서도 부진"
- * 구로다, 헬리콥터 머니 일축..."전혀 생각안해"
 - "국채매입·마이너스 금리, 한계 도달하지 않아"
 - "정책 효과 포괄적 평가 후 필요하면 분명히 추가 조치 검토"
 - "재정 파이낸스(지원)는 전혀 생각하고 있지 않다"면서 재정·통화정책의 통합 운영은 금지돼 있다고 언급. 이는 중앙은행이 국채를 직접 인수하는 정부 부채의 화폐화를 용인할 수는 없다는 의미로 풀이.
- * 日 관방장관 "환시 신경질적...필요시 대응"
- * 러시아, 기준금리 10.5%로 동결

[국내]

- * "은행·정부에 기업부실 책임 과도하게 물으면 구조조정 차질"
- * 국회 예정처 "추경으로 외평기금 출연 타당성 부족"
- * 유일호 "2%대 잠재성장률로 고령화 위기 넘을지 걱정"
- * 한은 "저물가 이끈 유가충격, 1년내 소멸...2차 효과 없다"
- * 금융당국 "조선사 대출회수 자제"에 은행권 '고민'

****주간 예정 지표****

8월 1일

[증권·외환시장 거래시간 30분 연장]

미국-7월 제조업PMI (이전:52.9, 예상:52.9)

-7월 ISM제조업PMI (이전:53.2, 예상:53.0)

중국-7월 제조업PMI (이전:50.0, 예상:50.0)

-7월 비제조업PMI (이전:53.7)

-7월 Caixin 제조업PMI (이전:48.6, 예상:48.7)

유로존-7월 제조업PMI (이전:51.9, 예상:51.9)

독일-7월 제조업PMI (이전:53.7, 예상:53.7)

일본-7월 제조업PMI (이전:49.0, 예상:49.0)

한국-6월 경상수지 (이전: 8.12B)

-7월 수출액(YoY) (이전:-2.7%, 예측:-4.6%)

-7월 수입액(YoY) (이전:-7.7%, 예측:-9.5%)

-7월 무역수지 (이전: 11.50B)

-7월 Nikkei 한국 제조업 구매관리자지수 (이전:50.5)

8월 2일

[호주중앙은행(RBA) 기준금리 결정]

미국-6월 개인소비(MoM) (이전:0.4%, 예상:0.3%)

-6월 근원PCE물가지수(MoM) (이전:0.2%, 예상:0.1%)

유로존-6월 PPI(MoM) (이전:0.6%, 예상:0.4%)

한국-7월 한국 외환보유고(미국달러) (이전:369.89B)

-7월 한국 소비자 물가지수(YoY) (이전:0.8%, 예측:0.8%)

-7월 한국 소비자 물가지수(MoM) (이전:0.0%, 예측:0.2%)

8월 3일

[일본은행(BOJ) 6월 금융정책회의 의사록]

미국-7월 ADP비농업고용변동 (이전:172K, 예상:170K)

-7월 ISM비제조업PMI (이전:56.5, 예상:56.0)

-7월 Markit종합PMI (이전:51.2, 예상:51.2)

-7월 서비스PMI (이전:50.9, 예상:51.0)

중국-7월 Caixin서비스PMI (이전:52.7, 예상:52.9)

유로존-7월 Markit종합PMI (이전:52.9, 예상:52.9)

-7월 서비스PMI (이전:52.7, 예상:52.7)

-6월 소매판매(MoM) (이전:0.4%, 예상:0.1%)

독일-7월 종합PMI (이전:55.3, 예상:55.3)

-7월 서비스PMI (이전:54.6, 예상:54.6)

8월 4일

[BOE 통화정책회의]

미국-신규실업수당청구건수 (이전:266K, 예상:265K)

-6월 공장주문(MoM) (이전:-1.0%, 예상:-1.8%)

8월 5일

[야후메신저 구버전 종료]

미국-7월 비농업고용 (이전:287K, 예상:175K)

-6월 무역수지 (이전:-41.10B, 예상:-43.00B)

-7월 실업률 (이전:4.9%, 예상:4.9%)

-7월 시간당평균임금(MoM) (이전:0.1%, 예상:0.2%)

독일-6월 공장주문(MoM) (이전:0.0%, 예상:0.6%)
