<IPS 외국환중개 2016년 8월 3일 시황>

http://www.ipscorp.co.kr/24_IrProducts.asp

1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가, 일본은행(BOJ)의 통화정책과 정부 경기 부양책에 대한 실망으로 급락한 일본 국채가격 영향으로 하락

* 도쿄금융시장에서 일본 국채수익률은 10년 만기 채권의 입찰 부진으로 전 구간에서 급등

- 특히 10년물 벤치마크 수익률은 장중에 지난 3월16일 이후 최고 수준인 마이너스(-) 0.025%까지 상승 (전일 종가 -0.13%)

- 이날 유럽과 미국 국채수익률의 동반 상승 이끌어

[미국]

2y 0.68% (-0.6bp)

10y 1.56% (+3.4bp)

30y 2.31% (+3.7bp)

[기타 10Y물]

영국 0.81% (+7.8bp)

독일 -0.04% (+6.2bp)

프랑스 0.18% (+6.2bp)

이탈리아 1.21% (+3.5bp)

스페인 1.07% (+5.2bp)

그리스 8.08% (+5.6bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 유가 급락·엇갈린 경기지표에↓…다우 7일째 하락

- 국제 유가가 배럴당 40달러 아래로 내려가면서 일제히 하락 출발

- 포드와 제너럴모터스(GM)의 7월 자동차 판매가 기대에 못 미친 것도 악재로 작용

-美 경제지표 엇갈려

6월 개인소비(MoM) 0.4% → 0.4% (예상:0.3%)

6월 근원PCE물가지수(MoM) 0.2% → 0.1% (예상:0.1%)

* <유럽 마감> 유럽증시, 은행주 부진 여파 일제 하락

* <상하이 마감> 중국 국유자산감독관리위원회(국자위)의 국영기업 개혁 의지에 관련주가 오르며 상승…0.61%↑

DOW30 18313.77 (-0.49%)…7일 연속 하락

NASDAQ 5137.73 (-0.90%)

S&P500 2157.03 (-0.64%)

NIKKEI225 16391.45 (-1.47%)

SHANGHAI 2971.28 (+0.61%)

FTSE100 6645.40 (-0.73%)

DAX30 10144.34 (-1.80%)

CAC40 4327.99 (-1.84%)

3.글로벌 환시

* 달러, 답보 상태의 물가 상승률로 경제 부진 우려가 커져 주요 통화에 하락

유로/달러 1.1221 (+0.0060)

유로/엔 113.20 (-1.06)

달러/엔 100.88 (-1.50)

달러/위안 6.6451 (+0.0174)

파운드/달러 1.33549 (+0.01811)

NDF 1112.00 / 1112.70원...2.00원↑

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 국제유가, 공급과잉 우려 지속...WTI 4개월 만에 40달러 붕괴

* <국제 금값> 조기 금리인상 가능성 약화로 1% 상승

WTI 39.51 (-1.40%)

COMEX금 1372.60 (+1.00%)...2014년 3월 이후 최고치

5. 전일 국내 지표

코스피 2019.03 (-0.52%)

코스닥 700.90 (-0.40%)

원/달러 1110.10 전일비 +2.10원

*KTB: 111.11, 전일비 -5틱

*LKTB: 133.63, 전일비 -27틱

6. 전일 국내 주요 금리: 미국 금리의 상승 및 장중 외인의 10년 선물 대량 매도세에 국채 금리 역시 상승 마감. 어제 RBA 금리 인하 및 BOJ 통화완화 정책 발표 등 굵직한 이벤트들에도 불구하고 시장의 변동폭은 작았음.

3y 1.212% (0bp)

5y 1.230% (+0.7bp)

10y 1.378% (+1.5bp)

CD 1.360% (0bp)

7. 본드-스왑 스프레드

3y -2.0bp (+0.8bp)

5y -2.8bp (+1.3bp)

10y -12.8bp (+1.5bp)

8. IRS/CRS 동향: IRS 시장은 채권 시장과 연동하여 금리 상승 및 수익률 곡선 스티프닝. 굵직한 해외 이벤트 발표에도 불구 장중 변동폭은 제한 되었으며, 여전히 한산한 분위기. CRS는 오전에 부채 스왑 물량에 금리 및 커브가 6-7bp까지 급하게 올랐으나 이후 장기쪽에서 오퍼가 나오며 축소폭을 줄이며 마감.

*IRS 금리

1Y 1.2425% (+0.50bp)

2Y 1.1975% (+1.00bp)

3Y 1.1925% (+0.75bp)

5Y 1.2025% (+2.00bp)

7Y 1.2100% (+2.50bp)

10Y 1.2500% (+3.00bp)

1*2Y -4.25 (+0.50bp)

2*3Y -0.75 (-0.25bp)

2*5Y 0.25 (+1.00bp)

3*5Y 1.00 (+1.25bp)

5*7Y 0.75 (+0.50bp)

5*10Y 3.75 (+1.00bp)

*CRS 금리

1Y 1.1700% (+1.00bp)

2Y 1.0350% (+1.50bp)

3Y 0.9900% (+2.00bp)

5Y 0.9450% (+3.50bp)

7Y 0.9300% (+3.00bp)

10Y 0.9250% (+3.50bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* 록하트 애틀랜타연은 총재, 9월 혹은 연말 금리 인상 가능성 배제 안해

- 미국 소비활동이 아주 강한 상태로 남아있다며 아마도 단기적인 영국의 유럽연합(EU) 탈퇴(브렉시트) 영향은 지나간 것으로 보인다고 평가

* 日재무상 "국채 50년물 발행계획 없다...40년물 더 발행"

- "국채 총 발행량을 늘리진 않을 것"

* 아일랜드중앙銀 "브렉시트 후폭풍서 아직 못 빠져나왔다"

[국내]

* 금통위 "금리인하·추경, 하방위험 완충…성장 불확실"(상보)

* 금통위원 "채권시장 쏠림 심화…분트텐트럼 같은 급변동 가능성"

* 금통위원 "6월 금리인하・추경편성, 경기하방위험 완충"

* 외환보유액 15억弗 증가…저금리에 채권매매 차익

- 유로, 파운드화, 엔화 등 주요국 통화의 절하에도 글로벌 저금리 기조가 지속된 영향으로 우리나라의 외환보유액이 증가

금일 예정 지표

[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)

한국-7월 외환보유고(미국달러) (7월) (이전:369.89B, 발표:371.38B)