<IPS 외국환중개 2016년 8월 11일 시황>

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

1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 미 국채가격, 영국발 안전자산 품귀 현상 & 고용 호조에도 다른 지표 부진 탓에 연준의 기준금리 인상 기대 약화로 상승

* 영국 단기 국채 수익률 마이너스로 전환 <다우존스>

- 높은 투자 수요가 국채 가격을 끌어올린 것

- 2019년 3월과 9월, 2020년 3월 만기 국채 수익률이 모두 마이너스(-)로 돌아서

- 10년물 영국 국채 수익률도 연 0.52%까지 하락하며 사상 최저치를 기록

[미국]

2y 0.68% (-2.8bp)

10y 1.51% (-4.0bp)

30y 2.23% (-3.4bp)

[기타 10Y물]

영국 0.52% (-5.5bp)

독일 -0.11% (-3.2bp)

프랑스 0.10% (-3.6bp)

이탈리아 1.07% (-4.3bp)

스페인 0.94% (-5.5bp)

그리스 8.08% (-2.5bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 국제유가 약세에 하락…다우 0.20% 하락 마감

- 국제 유가 하락에 따른 에너지 관련 업종 부진 (-1.4%)

-美 경제지표

6월 JOLTs구인건수 5.514M → 5.624M (예상:5.574M)

* <유럽 마감> 유가 하락·실적 부진 여파, 6일 만에 하락 반전

- 세계 최대 산업용 효소 제조업체인 덴마크의 노보짐 & 독일 에너지업체인 에온, 실적 부진으로 주가 급락

* <상하이 마감> 상승동력 부족에 하락…0.23%↓

* <도쿄 마감> 엔화 강세에 휴일 앞둔 경계…0.18%↓

DOW30 18495.66 (-0.20%)…

NASDAQ 5204.58 (-0.40%)

S&P500 2175.49 (-0.29%)

NIKKEI225 16735.12 (-0.18%)

SHANGHAI 3018.75 (-0.23%)

FTSE100 6866.42 (+0.22%)

DAX30 10650.89 (-0.39%)

CAC40 4452.01 (-0.36%)

3.글로벌 환시

* 달러, 연준 올해 금리 인상 의구심으로 하락

유로/달러 1.1174 (+0.0059)

유로/엔 113.20 (-0.07)

달러/엔 101.26 (-0.58)

달러/위안 6.6530 (-0.0064)

파운드/달러 1.30053 (+0.00034)

NDF 1097.00 / 1097.50원...1.70원 상승

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 美 원유재고 예상밖 증가에↓...WTI 2.48%↓

- 사우디아라비아의 산유량이 또 다시 사상 최고치를 기록한 것도 악재로 작용

* <국제 금값> 연준 조기 금리인상 전망 약화로 0.4% 상승

WTI 41.71 (-2.48%)

COMEX금 1351.90 (+0.40%)

5. 전일 국내 지표

코스피 2044.64 (+0.04%)

코스닥 707.46 (+0.96%)

원/달러 1095.40 전일비 -10.70원

*KTB: 111.10, 전일비 +6틱

*LKTB: 133.58, 전일비 +31틱

6. 전일 국내 주요 금리: 전일 미국 국채 금리 하락 및 외국인의 선물 순매수에 채권시장은 강세를 보임. 금일 금통위에 대해서 채권시장의 대부분은 금리 동결을 예상하고 있고, 소수의견의 여부에 따라 금리 인하 기대감을 키울수도 있다는 전망.

3y	1.215%	(-3.2bp)
5y	1.240%	(-3.2bp)
10y	1.391%	(-3.6bp)
CD	1.360%	(0bp)

7. 본드-스왑 스프레드

3y	-1.5bp	(+1.0bp)
5y	-3.0bp	(+0.7bp)

10y -13.9bp (+0.1bp)

8. IRS/CRS 동향: IRS는 지준일 및 금통위 대기에 거래가 많지 않았고, 금리는 채권시장과 연동, 하락. 스프레드가 현물 대비 낙폭이 컸으나, 장 마감 직전 비드가 올라오며 커브를 소폭 되돌림.

*IRS 금리

1Y 1.2475% (-1.50bp)

2Y 1.2025% (-2.00bp)

3Y 1.1975% (-2.50bp)

5Y 1.2125% (-2.25bp)

7Y 1.2225% (-2.75bp)

10Y 1.2525% (-3.50bp)

1*2Y -4.50 (-0.50bp)

2*3Y -0.50 (-0.50bp)

2*5Y 1.00 (-0.25bp)

3*5Y 1.50 (+0.25bp)

5*7Y 1.00 (-0.50bp)

5*10Y 4.00 (-0.25bp)

*CRS 금리

1Y 1.2250% (0bp)

2Y 1.1200% (+1.5bp)

3Y 1.0800% (+2.0bp)

5Y 1.0400% (+3.0bp)

7Y 1.0200% (+3.0bp)

10Y 1.0000% (+2.5bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* 뉴질랜드중앙은행, 기준금리 2.0%로 25bp 인하

- 물가 상승 기대가 추가로 하락할 위험이 있어 앞으로 통화정책이 경기 조절적으로 남아 있을 것

- 환율 하락과 추가 통화정책 완화가 필요할 것

* 美국채 이자 받는 일본…8월 엔高 현실화되나 <니혼게이자이>

- 여름 휴가철로 접어들면서 시장 참가자들이 적어진 상황이라 미 국채 이자 지급이 겹치면 엔화가 평소보다 강세로 기울기 쉬워

- 8월 엔고설이 나온 것은 미 국채의 이자를 받은 투자자들이 수중의 달러를 엔으로 환전할 것이라는 추측에서 비롯

[국내]

* 8월 금통위 결정과 채권시장 시나리오

- 서울채권시장 참가자들은 이달 한국은행 금융통화위원회에서 기준금리가 만장일치로 동결될 것으로 전망

- 연내 추가 금리인하 기대감을 가져가지만 그 시기를 저울질하기에는 이르다는 판단

* HSBC "한국은행, 4분기 금리 인하 재개할 것"

* ING "韓, 4분기 금리인하"...동결 전망 철회

금일 예정 지표

[한국 금융통화위원회]

[일본 휴장 (산의 날)]

미국-신규실업수당청구건수 (이전:269K, 예상:265K)

-7월 수출가격지수(MoM) (이전:0.8%, 예상:0.1%)

-7월 수입가격지수(MoM) (이전:0.2%, 예상:-0.3%)

한국-8월 기준 금리 결정 (예측:1.25%, 이전:1.25%)