

<IPS 외국환중개 2016년 8월 24일 시황>

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

1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 미국 국채가격, 주 후반 재닛 옐런 연준 의장의 연설을 앞두고 관망세가 짙은 영향으로 혼조세

[미국]

2y 0.74% (+0.4bp)

10y 1.55% (+0.3bp)

30y 2.23% (-0.8bp)

[기타 10Y물]

영국 0.54% (-1.5bp)

독일 -0.10% (-0.7bp)

프랑스 0.13% (-0.2bp)

이탈리아 1.12% (+1.5bp)

스페인 0.93% (-0.03bp)

그리스 7.90% (+0.2bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 부동산 지표·원자재 강세에 일제 상승...다우 0.1% ↑

-美 경제지표...부동산 지표 호조

7월 신규주택판매(MoM) 3.5% → 12.4% (예상:-2.0%)...2007년 10월 이후 약 9년 만에 최대 증가폭

8월 제조업PMI 52.9 → 52.1 (예상:52.6)...소폭 하락했으나 확장세 지속

* <유럽 마감> 경기지표·원자재 호조에 약 20일 만 최대 상승

유로존-8월 제조업PMI 52.0 → 51.8 (예상:52.0)

-8월 Markit종합PMI 53.2 → 53.3 (예상:53.1)

-8월 서비스PMI 52.9 → 53.1 (예상:52.8)

* <상하이 마감> 투자심리 위축에 상승폭 축소...0.16% ↑

* <도쿄 마감> 안전자산 선호로 약세...0.61% ↓

DOW30 18547.30 (+0.10%)

NASDAQ 5260.08 (+0.30%)

S&P500 2186.90 (+0.20%)

NIKKEI225 16497.36 (-0.61%)

SHANGHAI 3089.71 (+0.16%)

FTSE100 6868.51 (+0.59%)

DAX30 10592.88 (+0.94%)

CAC40 4421.45 (+0.72%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 신규주택판매 지표 호조로 유로화에 올랐으나 다른 통화에는 약보합세를 나타내는 등
재닛 옐런 연준 의장의 주 후반 연설을 앞두고 혼조세

유로/달러 1.1304 (-0.0015)

유로/엔 113.30 (-0.25)

달러/엔 100.22 (-0.09)

달러/위안 6.6586 (-0.0066)

파운드/달러 1.31969 (+0.00623)

NDF 1120.20 / 1121.20원...4.90원 ↑

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 이란 생산량 동결 지지 가능성에 1.46% 상승

* <국제 금값> 재닛 옐런 연준 의장의 연설이라는 대형 이벤트를 앞두고 관망세가 이어진 가운데 0.2% 상승

WTI 48.10 (+1.46%)

COMEX금 1346.10 (+0.20%)

5. 전일 국내 지표

코스피 2049.93(+0.38%)

코스닥 687.38(-0.11%)

원/달러 1115.60, 전일비 -10.90원

*KTB: 111.06, 전일비 +1틱

*LKTB: 133.25, 전일비 +16틱

6. 전일 국내 주요 금리: 국고채 금리는 하락 마감. 시장을 움직일 재료가 없었지만 외국인들이 10년 국채선물을 매수하면서 강세 흐름을 이끔. 시장 참여자들은 재닛 옐런 미국 연방준비제도 (Fed·연준) 의장의 잭슨홀 심포지엄 연설을 앞둔 시점이어서 금리가 박스권을 벗어나기 어려울 것으로 전망.

3y 1.228% (-0.4bp)

5y 1.251% (-0.7bp)

10y 1.422% (-1.3bp)

CD 1.340% (0bp)

7. 본드-스왑 스프레드

3y -2.1bp (-0.1bp)

5y -3.1bp (-0.3bp)

10y -14.7bp (-0.2bp)

8. IRS/CRS 동향: IRS 금리는 하락 마감. IRS금리가 전체적으로 내려가면서 수익률 곡선은 플랫됨. 재료가 없는 가운데 국채선물 강세의 영향을 많이 받음. CRS는 여전히 장기물쪽으로 거래가 집중되는 가운데 금리의 큰 변동은 없었음.

*IRS 금리

1Y 1.2450% (-0.25bp)

2Y 1.2100% (-0.50bp)

3Y 1.2075% (-0.50bp)

5Y 1.2200% (-1.00bp)

7Y 1.2325% (-1.25bp)

10Y 1.2750% (-1.50bp)

1*2Y -3.50 (-0.25bp)

2*3Y -0.25 (0bp)

2*5Y 1.00 (-0.50bp)

3*5Y 1.25 (-0.50bp)

5*7Y 1.25 (-0.25bp)

5*10Y 5.50 (-0.50bp)

*CRS 금리

| | | |
|-----|---------|----------|
| 1Y | 1.2050% | (-0.5bp) |
| 2Y | 1.1200% | (-0.5bp) |
| 3Y | 1.0950% | (-0.5bp) |
| 5Y | 1.0650% | (-1.0bp) |
| 7Y | 1.0400% | (-1.0bp) |
| 10Y | 1.0400% | (-1.0bp) |

9. 주요뉴스

[해외]

* 美 지역 연은 8곳, 7월에 25bp 재할인율 인상 요구...전달보다 2곳 ↑

- 연준은 23일 의사록 공개를 통해 8곳의 지역 연은이 최근 경제여건과 전망의 개선, 물가가 목표치인 2%를 향해 점진적으로 오를 것이라는 기대 등을 이유로 7월에 1%인 재할인율을 1.25%로 인상할 것을 요구

- 8곳은 보스턴, 클리블랜드, 리치먼드, 샌프란시스코, 필라델피아, 세인트루이스, 캔자스시티, 댈러스

* 미 MMF 규제 앞두고 웰스파고 등 단기은행채 유동성 압박 <다우존스>

* "유럽 경제 안정적인 성장 지속성 의문" <WSJ>

- 유럽 경제가 최근 상당히 안정적인 모습을 보이지만, 경제 안정의 일관성은 부족

- 미국 증시가 최근 사상 최고치를 경신한 것 대비 유럽 증시 상승세는 강하지 않다며 이는 투자

자들이 유럽 경제에 대한 신뢰가 강하지 않기 때문

- 많은 투자자가 올해 초 유럽 주가 상승에 대한 기대를 크게 가지고 있었으나 오히려 실질적인 매수세는 신흥시장으로 몰렸다고 평가
- 유럽 지역의 정치적인 위험이 아직 경제에 확실히 반영되지 않은 데다 유럽 은행 시스템 또한 지속적인 우려로 남아 있다고 진단

* 피치, 브렉시트 영국 연금에 단기적으로 부정적

- 브렉시트 결정 후 기준금리 인하와 양적완화(QE) 정책은 확정급여형 연금에 가입된 기업들을 위한 연금의 부채를 증가시킨다고 진단
- 다만 연금의 증가하는 부채와 적자는 장기적으로 실질 금리가 인상되면서 반전되기 시작할 것
- 중장기적으로 영국의 통화정책이 결국 정상화되면서 실질 금리가 현재 수준보다 다소 높아질 것

* 무디스, 멕시코 은행 시스템 전망 '부정적'으로 하향

* ECB 집행이사, 유럽 경제 개혁이 장기 성장에 핵심

* 터키 중앙은행, 하루짜리 대출금리 8.50%로 25bp 인하

[국내]

* 대우조선 회사채 50%대 투매...일부 개인투자자 '기웃'

* 중진공, 달러채 발행 5억불 조달...금리 2.236%

* 수입물량지수, 석 달 만에 하락전환...폭스바겐 영향

* 유일호 "추경 골든타임 지나고 있어...비통한 심정"

금일 예정 지표

미국-7월 기존주택판매(MoM) (이전:1.1%, 예상:-0.4%)

-8월 제조업PMI (이전:52.9, 예상:52.7)

독일-2분기 GDP(QoQ) (이전:0.4%, 예상:0.4%)
