

<IPS 외국환중개 2016년 8월 26일 시황>

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

1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 미국 국채가격, 연준 위원들의 매파 발언에다 7월 내구재수주 호조 영향으로 하락

* 美 FRB 정책위원들, 또 금리 인상 시사

- 에스더 조지 캔자스시티 연은 총재, "금리 인상 점진적으로"

- 로버트 카플란 델러스 연은 총재, 기준금리 인상 논거 강화 시사

...다만 기준금리 인상 시기는 언급 없어

[미국]

2y 0.79% (+2.8bp)

10y 1.57% (+1.2bp)

30y 2.26% (+1.6bp)

[기타 10Y물]

영국 0.57% (+1.9bp)

독일 -0.07% (+1.9bp)

프랑스 0.16% (+2.0bp)

이탈리아 1.13% (+0.7bp)

스페인 0.92% (-1.1bp)

그리스 7.89% (+1.3bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 연준 위원들 금리인상 지지 발언...다우 0.18% 하락 마감

-美 경제지표 호조...기준금리 인상 가능성 높여

신규실업수당청구건수 262K → 261K (예상:265K)

7월 내구재주문(MoM) -4.2% → 4.4% (예상:3.3%)...작년 10월 이후 9개월 만에 최대 증가폭을 기록

* <유럽 마감> 유럽증시, 獨 경기지표 부진에 나흘만에 하락 반전

독일-8월 Ifo기업환경지수 108.3 → 106.2 (예상:108.5)

* <상하이 마감> 당국 긴축 우려에 하락...0.57%↓

* <도쿄 마감> 잭슨홀 심포지엄 앞두고 하락...0.25%↓

DOW30 18448.41 (-0.18%)

NASDAQ 5212.20 (-0.11%)

S&P500 2172.47 (-0.14%)

NIKKEI225 16555.95 (-0.25%)

SHANGHAI 3068.33 (-0.57%)

FTSE100 6816.90 (-0.28%)

DAX30 10529.59 (-0.88%)

CAC40 4406.61 (-0.65%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 7월 내구재수주 등 경제지표 호조에다 연준 위원들의 매파 발언으로 기준금리 인상 기대가 높아져 상승

유로/달러 1.1283 (+0.0020)

유로/엔 113.41 (+0.28)

달러/엔 100.50 (+0.05)

달러/위안 6.6602 (+0.0182)

파운드/달러 1.31888 (-0.00423)

NDF 1115.50 / 1,116.10원...0.30원 ↓

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 산유량 동결 기대·달러 약세에 1.2% 상승

* <국제 금값> 연준 매파 전면 부상에 0.4% 하락

WTI 47.33 (+1.20%)

COMEX금 1324.60 (-0.40%)

5. 전일 국내 지표

코스피 2042.92(-0.04%)

코스닥 683.96(-0.56%)

원/달러 1115.90, 전일비 -6.10원

*KTB: 111.03, 전일비 -1틱

*LKTb: 133.33, 전일비 +8틱

6. 전일 국내 주요 금리: 국고채 금리는 단기물 위주로 상승하며 커브 플래트닝. 전일 미국채금리는 로버트 카플란 델러스 연방준비은행 총재가 올해 미국 기준금리가 인상될 것으로 전망했다는 소식에 상승하며 그 영향을 받음.

3y 1.236% (+0.7bp)

5y 1.263% (+0.8bp)

10y 1.422% (+0.4bp)

CD 1.340% (0bp)

7. 본드-스왑 스프레드

3y -2.4bp (-0.5bp)

5y -4.5bp (-1.1bp)

10y -15.0bp (-0.7bp)

8. IRS/CRS 동향: IRS 금리는 역시 단기물 위주 상승, 약보합권 마감. 5년물 거래가 잦았으며, 금리 변동폭은 잭슨홀 미팅 대기 심리에 크지 않았음. CRS 역시 잭슨홀 미팅 결과 후 방향성이 정해질 전망.

*IRS 금리

1Y 1.2550% (+0.75bp)

2Y 1.2175% (+0.25bp)

3Y 1.2125% (+0.25bp)

5Y 1.2175% (-0.25bp)

7Y 1.2300% (-0.25bp)

10Y 1.2725% (-0.25bp)

1*2Y -3.75 (-0.50bp)

2*3Y -0.50 (0bp)

2*5Y 0.00 (-0.50bp)

3*5Y 0.50 (-0.50bp)

5*7Y 1.25 (0bp)

5*10Y 5.50 (0bp)

*CRS 금리

1Y	1.1700% (-3.0bp)
2Y	1.1150% (-0.5bp)
3Y	1.1000% (-0.5bp)
5Y	1.0600% (-1.5bp)
7Y	1.0300% (-1.5bp)
10Y	1.0300% (-1.5bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* 미 소매업종, 실적 둔화세 다시 등장 <다우존스>

- 이번 실적발표 기간 초반 메이시스 등의 실적 호조로 커진 미국 소매업종에 대한 투자자들의 긍정적인 기대가 최근 시그넷 주얼러, 달러 제너럴 등의 실적 부진으로 다시 낮아지고 있는 것으로 나타나

* 유럽 다음 골칫덩이는 포르투갈(?)...QE에서 제외될 위기

...투자등급 완전히 잃으면 ECB 국채매입 대상 못돼

...최근 국채금리 급등

- 포르투갈은 특히 캐나다 신용평가사 DBRS가 지난 16일 한 외신을 통해 경제성장 부진으로 신용등급에 압력이 쌓이고 있다는 경고를 보낸 뒤로 채권시장의 우려를 한몸에 받아

- 포르투갈 국채는 현재 DBRS가 부여한 투자적격 등급 덕분에 유럽중앙은행(ECB)의 국채매입 양

적완화(QE) 프로그램에 포함되고 있기 때문

- '빅3' 국제 신용평가사로 불리는 스탠더드앤드푸어스(S&P)와 무디스, 피치는 포르투갈 국채를 모두 투자부적격(정크) 등급으로 평가
- DBRS의 경고가 나온 지난 16일부터 22일까지 포르투갈의 10년 만기 국채금리는 매일같이 올라 총 32.3bp 급등

* S&P, 리우데자네이루 신용등급 'CCC-'로 3단계 강등

[국내]

- * 소비자심리지수 두 달째 상승...국가등급 상향 영향
- * 기재부, 9월 국고채 6.5조원 발행...전월비 2천500억 ↓
- * 고배 풀린 대출증가...2금융권·집단대출 풍선효과

금일 예정 지표

[재닛 옐런 연준 의장 잭슨홀 심포지엄 연설]

미국-2분기 GDP(QoQ) (이전:1.2%, 예상:1.1%)

-8월 미시간대소비자신뢰지수 (이전:90.4, 예상:90.6)

독일-9월 GfK소비자신뢰지수 (이전:10.0, 예상:9.9)

영국-2분기 GDP(QoQ) (이전:0.6%, 예상:0.6%)

한국-8월 소비자신뢰지수(이전:101, 발표:102)
