

<IPS 외국환중개 2016년 9월 5일 시황>

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

1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 미국 국채가격, 8월 비농업 부문 고용지표가 예상을 소폭 밑도는 수준으로 나오면서 수직으로 상승했다가 고용 증가 수준이 9월 기준금리 인상 불씨를 완전히 끄지는 못한다는 인식과 뉴욕증시 상승에 따른 위험자산 선호로 반락

[미국]

2y 0.79% (+0.4bp)

10y 1.60% (+3.4bp)

30y 2.28% (+4.8bp)

[기타 10Y물]

영국 0.72% (+5.9bp)

독일 -0.05% (+2.3bp)

프랑스 0.19% (+1.1bp)

이탈리아 1.17% (-0.1bp)

스페인 1.02% (-2.6bp)

그리스 7.93% (-1.2bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 고용지표 부진에 금리인상 우려↓ 일제 상승...다우 0.4%↑

-美 8월 고용지표, 예상 못 미쳐...실업률은 제자리

8월 비농업고용 275K → 151K (예상:180K)

8월 실업률 4.9% → 4.9% (예상:4.8%)

- 美 그 외 경제지표

7월 무역수지 -44.66B → -39.47B (예상:-42.70B)

7월 공장주문(MoM) -1.8% → 1.9% (예상:2.0%)

8월 시간당평균임금(MoM) 0.3% → 0.1% (예상:0.2%)

* <유럽 마감> 美 고용지표 부진에 '급등'...4개월 반 최고치

* <상하이 마감> 방향 부재 속 강보합...0.13% ↑

* <도쿄 마감> 美 고용지표 경계감 속 혼조

DOW30 18491.96 (+0.39%)

NASDAQ 5249.90 (+0.43%)

S&P500 2179.98 (+0.42%)

NIKKEI225 16925.68 (-0.01%)

SHANGHAI 3067.35 (+0.13%)

FTSE100 6894.60 (+2.20%)

DAX30 10683.82 (+1.42%)

CAC40 4542.17 (+2.31%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 8월 비농업부문 고용이 시장 예상을 밑돌았음에도 기준금리 인상 우려가 지속해 상승

유로/달러 1.1152 (+0.0043)

유로/엔 116.02 (+0.53)

달러/엔 103.97 (+0.78)

달러/위안 6.6727 (-0.0057)

NDF 1115.80 / 1116.00원...1.60원 ↓

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 美 고용지표 부진+러 산유량 동결 참여 시사에 급등

* <국제 금값> 고용 예상 소폭 하회에 0.7% 상승

WTI 44.44 (+2.97%)

COMEX금 1326.70 (+0.70%)

6. 전일 국내 주요 금리:장 초반부터 국내 채권금리는 보험권에서 벗어나지 못하고 정체된 모습을 보임. 외인이 3년과 10년 국채선물 매도세를 이어갔지만, 시장에 변동성을 주지는 못함. 오후에도 미국 고용지표를 대기하며 금리가 보험권에서 오르내림을 반복.

3y	1.326%	(-0.7bp)
5y	1.380%	(0)
10y	1.530%	(+0.6bp)
CD	1.340%	(0)

7. 본드-스왑 스프레드

3y	-3.9bp	(-0.3bp)
5y	-7.5bp	(-1.0bp)
10y	-15.5bp	(-1.9bp)

8. IRS/CRS 동향: IRS는 강세 흐름으로 출발했지만 0.5bp 내외에서 등락을 반복함. 장 초반에는 단기물이, 장 후반에는 장기물 위주로 거래된걸로 보임. 전일 금리 상승에 따른 되돌림으로 하락 마감.

*IRS 금리

1Y	1.2950%	(-0.75bp)
2Y	1.2800%	(-1.25bp)
3Y	1.2850%	(-1.25bp)
5Y	1.3050%	(-1.00bp)
7Y	1.3225%	(-1.25bp)
10Y	1.3750%	(-1.25bp)

1*2Y	-1.50	(-0.50bp)
2*3Y	0.50	(0)
2*5Y	2.50	(+0.25bp)
3*5Y	2.00	(+0.25bp)
5*7Y	1.75	(-0.25bp)
5*10Y	7.00	(-0.25bp)

*CRS 금리

1Y	1.1650%	(-0.5bp)
2Y	1.1100%	(-0.5bp)
3Y	1.0950%	(-0.5bp)
5Y	1.0550%	(-0.5bp)
7Y	1.0150%	(-0.5bp)
10Y	1.0150%	(-0.5bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* 제프리 래커 리치먼드연은 총재 "고용 둔화하지 않으면 금리 인상해야"

- "물가상승률 위험에 더 많은 관심 필요"

- "빠른 금리 인상 경제 고통 야기"

* 채권 투자자들, 유럽 떠나 미국행...저금리 탓 <WSJ>

- 유럽중앙은행(ECB)이 최근 회사채 매입을 시작한 영향으로 미국 신용시장이 수혜

- 투자자들이 회사채를 ECB에 팔고 미국으로 건너가고 있어

- 중앙은행이 채권을 매입하는 변수가 없어 시장이 안정적인 점도 투자자들이 미국행을 선택한 배경으로 거론

[국내]

* 국내외 거시경제 및 채권전문가들은 한국은행 금융통화위원회가 이달 기준금리를 동결할 것으로 예측.

* 환율 연저점+운용수익'에 8월말 외환보유액 사상최대

주간 예정 지표

9월 5일

[미국 휴장 (노동절)]

[G20 정상회담 2일차 (~5일)]

중국-8월 Caixin서비스PMI (이전:51.7, 예상:51.9)

유로존-8월 Markit종합PMI (이전:53.3, 예상:53.3)

-8월 서비스PMI (이전:53.1, 예상:53.1)

-7월 소매판매(MoM) (이전:0.0%, 예상:0.6%)

영국-8월 서비스PMI (이전:47.4, 예상:50.0)

독일-8월 종합PMI (이전:54.4, 예상:54.4)

-8월 서비스PMI (이전:53.3, 예상:53.3)

9월 6일

[호주중앙은행(RBA) 기준금리 결정]

미국-ISM비제조업PMI (이전:55.5, 예상:55.0)

-8월 Markit종합PMI (이전:51.5, 예상:51.5)

-8월 서비스PMI (이전:50.9, 예상:50.9)

-8월 CB고용추세지수 (이전:128.30)

유로존-2분기 GDP(QoQ) (이전:0.3%, 예상:0.3%)

독일-7월 공장주문(MoM) (이전:-0.4%, 예상:0.5%)

9월 7일

[Beige Book]

미국-7월 JOLTs구인건수 (이전:5.624M, 예상:5.580M)

영국-7월 제조업생산(MoM) (이전:-0.3%, 예상:-0.4%)

-7월 산업생산(MoM) (이전:1.0%, 예상:-0.3%)

독일-7월 산업생산(MoM) (이전:0.8%, 예상:0.1%)

9월 8일

[ECB통화정책회의]

미국-신규실업수당청구건수 (이전:263K)

중국-8월 무역수지(USD) (이전:52.31B, 예상:58.30B)

-8월 수출(YoY) (이전:-4.4%, 예상:-3.5%)

-8월 수입(YoY) (이전:-12.5%, 예상:-1.2%)

일본-2분기 GDP(QoQ) (이전:0.0%, 예상:0.0%)

9월 9일

[한국 금통위]

[유로존 재무장관 협의체(유로그룹) 회의]

미국-7월 도매재고(MoM) (이전:0.3%, 예상:0.1%)

중국-8월 CPI(MoM) (이전:0.2%)

-8월 PPI(YoY) (이전:-1.7%)
