

<IPS 외국환중개 2016년 12월 16일 시황>

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

1.글로벌 채권

- * <뉴욕 채권> 국채가격, 연준의 내년 기준금리 인상 횡수 전망 증가 영향이 지속한 가운데 혼조
- * 국채가는 물가, 고용, 제조업 지표 호조에도 단기 낙폭 과대에 따른 반작용으로 유럽장에서의 낙폭을 줄이면서 출발
- * 미국의 제조업 생산이 21개월래 최고를 보인 여파로 국채가는 낙폭을 다시 벌렸고 오후 들어 오전의 거래 범위를 벗어나지 않는 움직임

[미국]

| | | |
|-----|-------|----------|
| 2y | 1.27% | (+0.4bp) |
| 5y | 2.10% | (+4.7bp) |
| 10y | 2.61% | (+3.7bp) |
| 30y | 3.17% | (-1.4bp) |

[기타 10Y물]

| | | |
|------|-------|-----------|
| 영국 | 1.48% | (+10.3bp) |
| 독일 | 0.36% | (+6.3bp) |
| 프랑스 | 0.77% | (+4.0bp) |
| 이탈리아 | 1.82% | (+3.0bp) |
| 스페인 | 1.41% | (+1.8bp) |
| 그리스 | 7.15% | (+17.7bp) |

2.글로벌 증시

- * <뉴욕 마감> 12월 미국 기준금리 인상과 앞으로 추가 인상 전망에 따른 금융주 강세로 상승
- * 금융주, 기준금리 인상으로 실적이 개선될 것이란 기대감으로 1.02% 오르며 지수 상승을 이끔
- * 美 11월 소비자물가, 전월 대비 0.2% 상승하며 4개월 연속 오름세... 주택과 가솔린 가격이 계속해서 오른 게 CPI를 견인한 것으로 분석
- * 주간 실업수당 청구건수, 전주보다 4000건 줄어든 25만4000건을 기록하며 3주만에 최저치... 93주째 30만건을 밑돌면서 고용시장 호조 지속할 것이라는 전망 뒷받침
- * 美 제조업 PMI 21개월래 최고치인 54.2 기록

* 미국 주택건설업체들의 체감 경기, 트럼프 대통령 당선 이후 규제 완화에 대한 기대감으로 11년 5개월 만에 최고치 기록

- 12월 주택시장지수, 예상치와 직전월 63을 크게 웃도는 70으로 집계

* 엠파이어스테이트 지역의 제조업 활동 지표는 경제 성장에 대한 낙관론으로 전월 1.5에서 9.0으로 큰 폭으로 올랐으며 12월 필라델피아연은 지수도 21.5을 기록하며 2년 만에 최고치

* <유럽 마감> 미국의 기준금리 인상 영향으로 은행주들이 강세를 보이면서 일제히 상승

* <상하이 마감> 미국의 기준금리 인상 여파에 혼조세... 금융주의 하락세가 컸으며 유가 하락으로 에너지주 또한 부진

* <도쿄 마감> 연준의 금리 인상 속도가 예상보다 더 빠를 것이란 기대로 엔화가 급락... 주가를 떠받치며 상승

| | | |
|-----------|----------|----------|
| DOW30 | 19852.24 | (+0.30%) |
| NASDAQ | 5456.85 | (+0.37%) |
| S&P500 | 2262.03 | (+0.39%) |
| NIKKEI225 | 19237.79 | (+0.10%) |
| SHANGHAI | 3117.68 | (-0.73%) |
| FTSE100 | 6999.01 | (+0.72%) |
| DAX30 | 11366.40 | (+1.08%) |
| CAC40 | 4819.23 | (+1.05%) |

3.글로벌 환시

* 달러화, 경제지표 호조 가세 상승 지속

유로화, 美 기준금리 인상 파장으로 한때 2003년 이래 최저수준인 1.0404달러까지 하락

| | | |
|-------|--------------------|---|
| 유로/달러 | 1.0411 | (-0.0121) |
| 유로/엔 | 123.02 | (-0.34) |
| 달러/엔 | 118.15 | (+1.03) |
| 달러/위안 | 6.9289 | (+0.0261)...위안화 가치, 약 8년 6개월만에 가장 낮은 수준 |
| NDF | 1182.10 / 1182.50원 | ...4.10원 상승 |

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 산유국들의 감산 이행 기대에도 달러화 강세로 소폭 하락

* <국제 금값> 연준이 시장 예상보다 내년 기준금리 인상 속도를 높일 것이라는 전망에 달러화가 강세를 보여 하락

WTI 50.90 (-0.3%)
 COMEX금 1129.80 (-2.9%)

5. 전일 국내 지표

코스피 2036.65 (-0.01%)
 코스닥 620.61 (+1.33%)
 원/달러 1178.50 (+8.80)
 KTB 109.44 (-0.15)
 LKTB 124.98 (-0.62)

6. 전일 국내 주요 금리

*국고채 금리가 상승. 미국이 내년 점도표를 상향조정한데 따른 글로벌 금리 상승 여파 때문으로 보임.
 -한은 금통위에서는 기준금리가 연 1.25%로 동결. 금통위가 채권시장에 미치는 영향은 제한됨.

CD(91일) 1.540% (0.0bp)

[국고채]

1y 1.568% (+2.5bp)
 3y 1.695% (+5.0bp)
 5y 1.886% (+5.5bp)
 10y 2.185% (+6.5bp)
 20y 2.200% (+5.2bp)
 30y 2.195% (+5.4bp)
 50y 2.190% (+5.4bp)

[통안채]

1y 1.5490% (+2.2bp)
 2y 1.6560% (+4.1bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1y -5.40bp (+1.30bp)
 2y -14.10bp (+0.40bp)
 3y -12.75bp (-0.75bp)
 5y -17.85bp (-0.25bp)
 10y -25.50bp (+1.00bp)

8. IRS/CRS 동향

IRS- 국채선물 약세에 전 구간 금리가 오름. 전일과 같이 2년물과 3년물 스프레드 거래가 많았음.
 CRS- CRS 금리도 상승. 부채스와프 물량의 영향으로 금리가 오른 것으로 보임.

*IRS 금리

| | | |
|-----|---------|-----------|
| 1Y | 1.4950% | (+3.50bp) |
| 2Y | 1.5150% | (+4.50bp) |
| 3Y | 1.5675% | (+4.25bp) |
| 5Y | 1.7075% | (+5.25bp) |
| 7Y | 1.8025% | (+6.25bp) |
| 10Y | 1.9300% | (+7.50bp) |

| | | |
|-------|-------|-----------|
| 1*2Y | 2.00 | (+1.00bp) |
| 2*3Y | 5.25 | (-0.25bp) |
| 2*5Y | 19.25 | (+0.75bp) |
| 3*5Y | 14.00 | (+1.00bp) |
| 5*7Y | 9.50 | (+1.00bp) |
| 5*10Y | 22.25 | (+2.25bp) |

*CRS 금리

| | | |
|-----|---------|-----------|
| 1Y | 1.1000% | (0.00bp) |
| 2Y | 1.1900% | (+2.00bp) |
| 3Y | 1.3000% | (+4.50bp) |
| 5Y | 1.4050% | (+5.50bp) |
| 7Y | 1.4000% | (+5.50bp) |
| 10Y | 1.3900% | (+5.50bp) |

9. 주요뉴스

[국내]

- *유일호, 日대사 면담..."경제·금융·외환협력 중요"
- *금융당국, 미매각 회사채 5천억 인수 내년 2월 시행

[해외]

- * BOE, 만장일치로 기준금리를 사상 최저수준인 0.25%로 동결하고 QE 규모도 700억파운드로 유지
- * 美 연준 내년 3번 금리인상 전망... 이르면 내년 3월 금리인상 가능 <골드만삭스>
 - 3월 금리 인상 확률 35% / 5월과 6월 인상 확률은 각각 10%와 40%로 부여
- * 美 연준이 내년 세 차례 기준금리가 인상될 수 있다고 시사... 트레이더들 6월 인상 가능성에 대한 베팅 늘

러 <CNBC>

* 홍콩, 미국의 금리 인상에 이어 기준금리를 25bp 인상한 1.00%로 인상

* 유로존 12월 합성 PMI 예비치 전월과 동일한 53.9 기록

독일 12월 제조업 PMI 예비치, 전월 확정치(54.3)와 예상치(54.5) 상회하는 55.5로 집계...2년 11개월래 최고

****금일 예정 지표****

미국-11월 건축허가(MoM) (이전:2.9%)

-11월 주택착공(MoM) (이전:25.5%)

유로존-11월 CPI(MoM) (이전:0.2%, 예상:-0.1%)

-11월 근원CPI(MoM) (이전:0.1%)

-10월 무역수지 (이전:26.5B, 예상:29.0B)