<IPS 외국환중개 2016년 8월 12일 시황>

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

1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 미국 국채가격, 뉴욕증시와 국제유가 등 위험자산 선호가 강해진 데다 30년물 입찰에서 약한 수요가 확인되면서 하락

[미국]

2y 0.74% (+6.0bp)

10y 1.56% (+6.4bp)

30y 2.27% (+4.5bp)

[기타 10Y물]

영국 0.54% (+1.1bp)

독일 -0.10% (+1.6bp)

프랑스 0.12% (+1.8bp)

이탈리아 1.06% (-1.6bp)

스페인 0.92% (-2.5bp)

그리스 8.01% (-7.5bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 3대 지수 모두 '사상 최고'...약 17년만에 처음

- 실적 호조·유가 급등·경기지표 호조 '3박자'

- 미국 최대 백화점 체인인 메이시스와 콜스, 실적 호조

- 에너지 업종, 1.3% 상승

- 美 경제지표 호조

신규실업수당청구건수 267K → 266K (예상:265K)

...30만건 75주 연속 하회 (1970년 이후 가장 긴 기록)

7월 수입물가지수(MoM) 0.6% → 0.1% (예상:-0.3%)...5개월 연속 상승

* <유럽 마감> 유가 급반등에 상승 마감... 佛 1.2% 급등

* <상하이 마감> 차익실현 압력에 하락...0.53%↓

* <도쿄 마감> '산의 날' 휴장

DOW30	18613.52	(+0.64%)...사상 최고치
NASDAQ	5228.40	(+0.46%)...사상 최고치
S&P500	2185.79	(+0.47%)...사상 최고치
NIKKEI225	16735.12	(0.00%)
SHANGHAI	3002.64	(-0.53%)
FTSE100	6914.71	(+0.70%)
DAX30	10742.84	(+0.85%)
CAC40	4503.95	(+1.17%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 다음날 발표되는 7월 소매판매가 호조를 보일 경우 미국의 기준금리 인상 기대가 재평가될 수 있다는 기대로 상승

유로/달러 1.1136 (-0.0038)

유로/엔 113.52 (+0.32)

달러/엔 101.91 (+0.65)

달러/위안 6.6255 (-0.0275)

파운드/달러 1.29546 (-0.00507)

NDF 1098.50 / 1099.00원...1.00원 하락

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 수개월 안에 원유시장이 리밸런싱을 나타낼 것이라는 국제에너지기구(EIA)의 전망과 사우디아라비아의 시장 리밸런싱 조치 협조 발언으로 4.27% 상승

* <국제 금값> 지난 7월 소매판매 결과 발표를 하루 앞둔 가운데 수요 지속 전망에도 달러화 강세로 0.1% 하락

WTI 43.49 (+4.27%)

COMEX금 1350.00 (-0.10%)

5. 전일 국내 지표

코스피 2048.80 (+0.20%)

코스닥 703.33 (-0.58%)

원/달러 1099.50 전일비 +4.10원

*KTB: 111.05, 전일비 -5틱

*LKTB: 133.52, 전일비 -6틱

6. 전일 국내 주요 금리: 국고채 금리는 약보합으로 마감. 금통위에서 시장의 예상대로 기준 금리가 1.25%에 만장일치 동결 되었으며, 이주열 한국은행 총재의 발언도 중립적으로 평가되며 금리에 큰 변동은 없었음.

3y	1.222%	(+0.7bp)
5y	1.248%	(+0.8bp)
10y	1.396%	(+0.5bp)
CD	1.360%	(0bp)

7. 본드-스왑 스프레드

3y	-1.5bp	(+0.3bp)
5y	-3.1bp	(-0.3bp)

10y -13.9bp (0bp)

8. IRS/CRS 동향: 통위가 IRS 금리는 금통위가 기준금리를 예상과 같이 동결하면서 큰 폭의 움직임은 제한. 금리는 전구간에 걸쳐 소폭 상승했으며, 커브는 불플랫.

*IRS 금리

1Y 1.2550% (+0.75bp)

2Y 1.2125% (+1.00bp)

3Y 1.2075% (+1.00bp)

5Y 1.2175% (+0.50bp)

7Y 1.2250% (+0.25bp)

10Y 1.2575% (+0.50bp)

1*2Y -4.25 (+0.25bp)

2*3Y -0.50 (0bp)

2*5Y 0.50 (-0.50bp)

3*5Y 1.00 (-0.50bp)

5*7Y 0.75 (-0.25bp)

5*10Y 4.00 (0bp)

*CRS 금리

1Y 1.2150% (-1.00bp)

2Y 1.1250% (+0.5bp)

3Y 1.0800% (+0.5bp)

5Y 1.0500% (+0.5bp)

7Y 1.0250% (+0.5bp)

10Y 1.0050% (+0.5bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* IMF "ECB, 마이너스 금리보다 자산매입 확대 바람직"

- ECB가 이미 마이너스(-)인 금리 수준을 추가로 낮춘다면 이는 시중은행들에 부정적인 영향을 미치게 되고 기업과 가계 대출 감소로 이어질 것

- 자산매입에 집중하는 것이 은행 대출을 지지하면서 자산 가격을 올리고 총 수요를 증가시킬 것이며 은행의 실물 경제 자금 공급을 촉진할 것

* 세계 중앙은행 금리 인하에도 왜 통화 약세 안 될까 <WSJ>

- 이론적으로 완화적인 통화정책은 통화가치 하락을 이끌어야 하지만 올해는 이와 반대되는 현상이 나타나...뉴질랜드, 호주, 일본 등

- 이유 중 하나로 이들 대부분 국가의 기준금리가 여전히 플러스(+)를 유지하고 있다는 것

- 세계 8조8천억달러 규모의 국채수익률이 마이너스(-)로 내려간 상황에서 조금이라도 높은 이익을 얻고자 하는 투자자들에게 이들 국가의 국채는 여전히 매력적이라는 분석

* 멕시코중앙은행, 기준금리 4.25%로 동결

[국내]

* 금통위, 1.25%로 두 달째 금리 동결…경제지표 확인

- 금통위 '가계부채 증가세, 주요국 통화정책 변화 점검'

- 금통위 '세계경제 미약한 회복세 지속'

- 금통위 '수출 감소, 내수 개선, 경제주체 심리 호전'

- 한은 "국내경기 성장세 이어나가지만 불확실성 높아"

* 한은, 연내 1%로 금리인하…추경 지연 탓<바클레이즈>

* 8월 금통위 기자간담회 이주열 총재 주요 발언

- 이주열 "금통위 금리결정, 전원일치"

- 이주열 "환율 하락, 투기자본 쏠림 우려할 상황은 아냐"

- 이주열 "가계부채 증가세 장기간 지속, 바람직하지 않아"

- 이주열 "저금리 장기화에 대한 리스크요인 항시 유념"

- 이주열 "충분한 성장세 보일 때까지 완화정책 유지"

- 이주열 "국내 장기금리, 주요국 통화정책에 영향받을 것"

- 이주열 "금리인하 효과, 기대만큼 크지 않은건 사실"

금일 예정 지표

미국-7월 소매판매(MoM) (이전:0.6%, 예상:0.4%)

-7월 PPI(MoM) (이전:0.5%, 예상:0.1%)

-7월 근원PPI(MoM) (이전:0.4%, 예상:0.2%)

-8월 미시간대소비자신뢰지수 (이전:90.0, 예상:91.5)

-6월 기업재고(MoM) (이전:0.2%, 예상:0.1%)

중국-7월 산업생산(YoY) (이전:6.2%, 예상:6.1%)

-7월 소매판매(YoY) (이전:10.6%, 예상:10.5%)

유로존-2분기 GDP(QoQ) (이전:0.3%, 예상:0.3%)

독일-2분기 GDP(QoQ) (이전:0.7%, 예상:0.2%)

-7월 CPI(MoM) (이전:0.4%, 예상:0.4%)

한국-7월 수출가격(YoY) (이전:-4.9%)

-7월 수입물가지수(YoY) (이전:-4.9%)