

■ 주요 뉴스: 미국 9월 소매판매(+0.7%), 예상(-0.2%) 밖 증가

- Goldman Sachs 3분기 실적 호조(순이익, 작년 대비 +63%)
- ECB 정책위원, 통화정책 수단의 유연성 유지 강조
- 중국인민은행,恒大그룹發 부채 위험 관리에 자신감 표명

■ 국제금융시장: 전일에 이은 기업실적 호조, 경제지표 개선으로 Risk-on

미 주가 상승[+0.7%], 달러화 보합[0.0%], 금리 상승[+6bp]

- 주가: 미국 S&P500 상승은 주요 IB 실적 호조, 소매판매 증가에 기인
유로 Stoxx600 지수도 금융주 주도로 0.7% 상승
- 환율: 달러화지수는 장기금리(강세)와 위험심리(약세) 영향이 상충
유로화도 보합(+0.03%), 엔화는 對美 금리차 확대에 0.5% 약세
- 금리: 미국 10년물 국채금리 상승에는 기대 인플레이션 상승도 영향
독일은 2bp 상승, 일본은 보합, 신흥국 채권 가산금리는 6bp 하락

※ 원/달러 1M NDF환율(1183.4원, +0.2원) 보합, 한국 CDS 1bp 하락

		10/15일	10/14일	전일대비			10/15일	10/14일	전일대비
주가	미국	4,471.4	4,438.3	0.75%	국채 금리 10y	미국	1.57%	1.51%	6bp
	유럽	469.39	465.92	0.74%		독일	-0.17%	-0.19%	2bp
	중국	3,572.4	3,558.3	0.40%	CDS 5y	한국	20bp	21bp	-1bp
	일본	29,069	28,551	1.81%		중국	49bp	53bp	-4bp
	한국	3,015.1	2,988.6	0.88%	위험 지표	EMBI+	371bp	377bp	-6bp
환율	달러지수	93.94	93.96	-0.02%		VIX	16.30	16.86	-3.32%
	유로화	1.1601	1.1597	0.03%		WTI유	82.28	81.31	1.19%
	엔화	114.22	113.68	-0.48%	원자재	구리	472.95	463.15	2.12%
	위안화	6.4357	6.4398	0.06%		금	1,767.6	1,795.9	-1.57%
	원화	1,182.4	1,186.8	0.37%					

주: 주가는 미국 S&P500, 유럽 Stoxx600, 중국 상해종합, 일본 닛케이225, 한국 KOSPI. NDF 환율 변화는 스왑포인트 감안한 전일 현물환 증가 대비. 환율은 달러화 대비 통화가치 등락(+/-는 절상, 절하). 자료: 블룸버그

금일의 포커스

■ 미국 소매판매, 예상 밖 증가

- 상무부, 9월 소매판매(계절조정)가 전월비 0.7% 증가했다고 발표(예상 -0.2%). 자동차(+0.6%)·식료품(+0.7%)·주유소(+1.8%)·일반판매점(+2.0%)·온라인(+0.6%) 등에 대한 수요가 고르게 증가하고 소비자 물가가 상승한 데 기인
- Wells Fargo, 신용카드 사용액으로 미루어볼 때 수요는 견조하다고 평가. Citigroup, 금번 소매판매 호조는 소비자들이 공급 부족을 우려해 휴가철 쇼핑을 앞당긴 결과일 수 있다면서 11~12월에는 소매판매가 감소할 수 있다고 경고

글로벌 동향 및 이슈

■ Goldman Sachs 3분기 기업실적 호조

- 순이익은 \$52.8억으로 작년(\$32.3억) 대비 +63%. 주당순이익은 \$14.93으로 작년(\$8.98)·예상(\$10.18) 상회. IB 수수료(+88%), 트레이딩 수익(+23%)이 기여

■ ECB 정책위원, 통화정책 수단의 유연성 유지 강조

- 빌루아 프랑스 중앙은행 총재, 시장 스트레스 상황에 대비하기 위해서는 팬데믹 긴급매입프로그램(PEPP) 종료 이후에도 자산매입의 유연성을 유지해야 한다는 최근의 입장을 되풀이하면서, 12월까지 다양한 옵션을 마련해야 한다고 강조

■ 중국인민은행, 헝다그룹 부채 위험 관리에 자신감 표명

- 금융시장국 췌우란(鄒瀾) 국장, 헝다그룹 부채 문제가 은행 시스템으로 확산될 위험은 통제가능하며, 對헝다그룹 익스포저는 특정 금융기관에 크게 집중되어 있지 않다고 언급. 헝다그룹에는 조속한 자산 처분을 촉구하고 있다고 부언
- 한편, Reuters는 지난 8월 매각이 성사된 것으로 여겨졌던 헝다그룹의 홍콩 본부 건물 매각건(對웨슈부동산, \$17억)이 무산된 사실을 보도. 웨슈부동산 측은 헝다그룹 재정난으로 거래가 원활하게 완료되기 어렵다고 판단한 것으로 확인

■ 유로존 8월 무역수지, 에너지 가격 상승으로 흑자 축소

- Eurostat, 8월 유로존 무역수지가 €111억(계절조정)을 기록했다고 발표. 전월(€135억) 및 전망치(€142억)를 하회했으며 에너지 수입 가격 상승에 기인. EU의 연 누적 에너지 적자(€1,519억)는 '20년(€1,087억) 대비 40% 확대

■ 일본은행, 성장률 전망치 하향 조정 가능성

- Reuters는 익명 관계자를 인용해, 일본은행(BOJ)이 아시아 지역 공장가동 중단에 따른 공급 차질로 일본 생산과 수출이 심각한 손상을 입을 것을 감안해 올해와 내년 GDP 성장률 및 CPI 상승률 전망치를 하향 조정할 것으로 보인다고 보도

■ 중국 규제당국, 對외국인 역내 파생상품시장 개방 확대

- 증권감독관리위원회(CSRC), 11/1일부터 적격외국인기관투자자(QFII)에게 원자재 선물, 원자재옵션, 주가지수옵션 거래를 허용할 계획을 발표. 외국인에게 더욱 다양한 헷지 수단을 제공함으로써 해외자본 유치에 도움이 될 것이라고 부언

■ 터키, 리라화 환율불안 재개(6일 연속 사상 최저 경신)

- 금주 들어 리라화의 對美달러 환율이 9리라를 상회(6영업일 간 -4.1%) 가운데 야당 대표는 10/21일 통화정책회의를 앞둔 중앙은행 총재와 회담. 에르도안 대통령은 금리인하에 반대 입장을 가진 통화정책 위원 3명을 해임한 바 있음

주요 경제지표

■ 주요 경제지표 발표 내용(10/15일 현지시각 기준)

- 미국 9월 소매판매(전년동월비): +0.7%, 8월(+0.9%), 예상치(-0.2%)
- 미국 10월 엠파이어스테이트 제조업지수: 19.8, 9월(34.3), 예상치(25.0)
- 미국 10월 미시건대 소비자태도지수: 71.4, 9월(72.8), 예상치(73.1)
- 일본 8월 3차산업 활동지수(전월비): -1.7%, 7월(-0.6%), 예상치(-1.2%)

■ 주요 경제 이벤트(10/18일 현지시각 기준)

- 미국 9월 산업생산(예상치 +0.2%), 중국 3분기 GDP(+5.0%), 싱가포르 9월 수출 등 경제지표 발표. 미국 미니아폴리스·캔사스시티 연은 총재 연설 예정

국제금융센터의 사전 동의 없이 무단 전재 금지 ; 본 자료 내용에 의거하여 행해진 투자행위 등에 대하여 일체 책임을 지지 않습니다. 문의: 02-3705-6211, E-mail swlee@kcif.or.kr