상상인증권

상상인 Macro Daily

투자전략팀 / 신얼, 황준호, 김현성, 최예찬 / 02 3779 3186 / jh.hwang@sangsanginib.com

2024-11-18

Korea Market

Stock (pt, %)	11/15	1D	1W	1M	3M	YTD
KOSPI	2,416.9	-0.1	-5.6	-8.2	-8.6	-9.0
KOSDAQ	685.4	+0.6	-7.8	-11.4	-11.8	-20.9
반도체		+5.6	-8.1	-11.7	-24.4	-21.4
건강관리		+0.2	-6.0	-11.1	-2.7	+6.8
자동차		+0.2	-0.6	-8.3	-8.4	-6.4
화학		-3.7	-13.6	-22.3	-19.3	-43.9
소매(유통)		-0.0	-8.1	-12.3	-12.0	-18.6
미디어, 교육		+2.3	-0.5	+3.0	+6.0	-23.5
필수소비재		-0.9	-3.3	+0.7	-2.0	+7.2
거래대금 (평균, 십억원)	18,653	18,653	18,404	16,197		
외국인 순매수 (누적, 십억원)		-61	-1,713	-4,846		
기관 순매수 (누적, 십억원)		-30	-82	+1,301		
개인 순매수 (누적, 십억원)		+38	+1,582	+3,121		
Money Flow (십억원, Δ)	**11/14**					
주식형 펀드	119,016	-1,084	-2,428	-2,165	+3,569	+16,024
채권형 펀드	177,282	+95	+83	+4,781	+8,279	+36,750

Global Market

Stock (pt, %)	11/15	1D	1W	1M	3M	YTD
DOW	43,445.0	-0.7	-1.9	+0.4	+6.4	+15.3
S&P 500	5,870.6	-1.3	-2.2	+0.1	+4.9	+23.1
NASDAQ	18,680.1	-2.2	-3.2	+1.0	+4.8	+24.4
유로 STOXX 50	4,794.9	-0.8	-1.2	-3.8	-1.3	+6.0
영국 FTSE 100	8,063.6	-0.1	-0.8	-3.5	-2.5	+4.3
일본 NIKKEI 225	38,642.9	+0.3	-2.3	-0.9	+1.5	+15.5
중국 상해종합	3,330.7	-1.5	-4.0	+2.1	+16.2	+12.0
VIX 지수	16.1	+12.8	+7.8	-10.5	+1.6	+29.6
MOVE 지수	102.5	+3.1	+2.6	-16.8	-8.2	-10.6

Daily Comment

Stock Market

- KOSPI는 전영업일대비 0.08% 하락한 2,416.86pt에 마감. 삼성전자의 저가 매수세에 따른 반등에도 불구하고, 미 재무부가 한국을 환율관찰대상국에 재포함 시키고 파월 연준 의장이 금리 인하 속도를 조절할 것을 시사한 것이 증시에 하방 압력으로 작용. 이에 KOSPI는 약보합 마감
- S&P 500은 전영업일대비 1.3% 하락한 5,870.62pt에 마감. 주요 연준 인사들의 매파적 발언들에 더해 10월 미국 소매판매 지표가 호조 및 수입물가 상승이 확인되면서 연준의 금리 인하 경로에 대한 불안감이 고조. 이에 증시는 하락 마감

Fixed Income

- 국고채 10년물 금리는 전영업일대비 0.5bp 상승한 3.080%에 마감. 10월 미국 소매판매 발표를 앞두고 파월 연준 의장이 기준금리 인하 속도 관련 매파적 발언을 했다는 소식이 국고채 시장의 약세장을 야기
- 미국채 10년물 금리는 전영업일대비 0.004bp 상승한 4.439%에 마감. 미국 10월 소매판매 호조에 더해 9월 수치 또한 대폭 상향조정 되면서 12월 FOMC에서 동결 가능성이 점차 높아지는 모습. 이에 미 국채 금리는 상승세를 시현

Currency

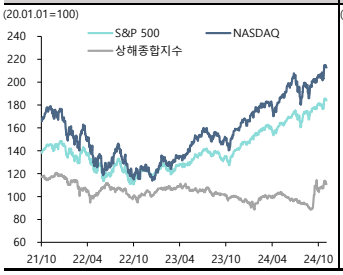
- 원/달러 환율은 전영업일대비 3.0원 하락한 달러당 1,399.5원에 마감. 정규장에서 위안화 강세와 당국 개입 경계심에 1,400원을 하향 돌파. 야간 거래에서 미국 소매판매 호조 소식에 소폭 상승하였으나 1,300원대에서 마감
- 달러 인덱스는 전영업일대비 0.01pt 상승한 106.69pt에 마감. 가파른 상승폭을 보인 달러화는 기술적 하방압력이 작용. 다만 미국 소매판매 호조와 12월 금리 동결 가능성은 미 달러화의 하단을 제한

Commodity

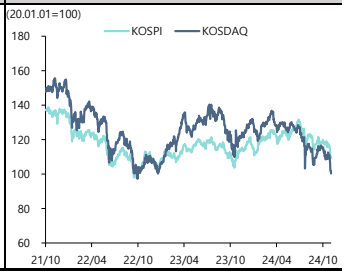
- 금(12월물)은 전영업일대비 0.07% 하락한 온스당 2,750.1달러에 마감. 금리 인하 신중론이 대두되는 가운데 소매판매 호조, 수입물가 상승 등 요인들은 금 가격 하방압력으로 작용
- WTI(12월물)은 전영업일대비 2.45% 하락한 배럴당 67.02달러에 마감. 중국 실물지표 악화에 더해 연준 금리 인하 기대가 후퇴하면서 유가는 약세 마감

주식시장동향

글로벌 주식



국내 주식



KOSPI 투자자별 매매동향

기관 수급

순매수 (십억원)		Daily		순매도 (십억원)	
대한항공	+17.1	1	LG에너지솔루션		-81.9
하이브	+12.7	2	삼성SDI		-20.7
삼양식품	+11.1	3	한화오션		-18.4
삼성에스디에스	+10.4	4	포스코퓨처엠		-17.2
두산	+8.9	5	CJ대한통운		-16.9
더존비즈온	+6.4	6	셀트리온		-7.4
HMM	+6.2	7	한국화장품제조		-6.8

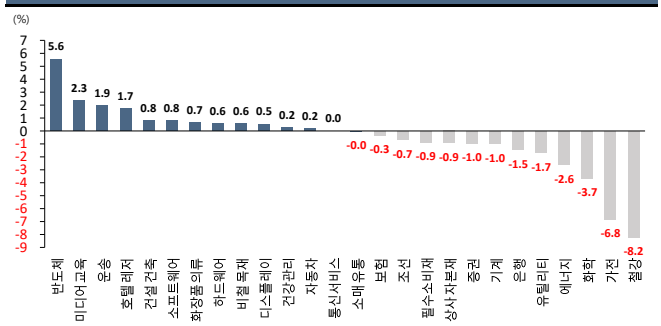
외국인 수급

순매수 (십억원)		Daily		순매도 (십억원)	
삼성전자	+128.8	1	한화오션		-32.3
포스코퓨처엠	+23.5	2	POSCO홀딩스		-20.2
HMM	+16.7	3	삼양식품		-16.5
우리금융지주	+7.9	4	한국전력		-13.7
현대로템	+5.9	5	HD현대중공업		-11.9
하이브	+4.5	6	삼성에스디에스		-8.2
금양	+4.2	7	대한항공		-7.7

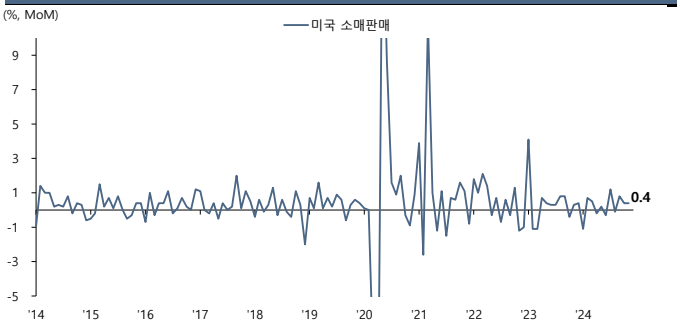
경제지표

DATE	국가	지표	예상	실제	이전
11/15 08:50	JN	GDP 연간화 SA 전분기대비	0.7%	0.9%	2.9%
11/15 08:50	JN	GDP SA (전기대비)	0.2%	0.2%	0.7%
11/15 08:50	JN	(전년동기대비)	2.7%	2.5%	3.2%
11/15 11:00	CH	광공업생산 YoY	5.6%	5.3%	5.4%
11/15 11:00	CH	소매판매 YoY	3.8%	4.8%	3.2%
11/15 13:30	JN	광공업생산 MoM	--	1.6%	1.4%
11/15 13:30	JN	3차 산업 지수 MoM	0.2%	-0.2%	-1.1%
11/15 16:00	UK	광공업생산 MoM	0.1%	-0.5%	0.5%
11/15 16:00	UK	제조업 생산 전월비	-0.1%	-1.0%	1.1%
11/15 16:00	UK	GDP(전분기대비)	0.2%	0.1%	0.5%
11/15 16:00	UK	GDP (전년동기대비)	1.0%	1.0%	0.7%
11/15 22:30	US	제조업지수 (뉴욕주)	0	31.2	-11.9
11/15 22:30	US	소매판매 추정 전월비	0.3%	0.4%	0.4%
11/15 23:15	US	광공업생산 MoM	-0.4%	-0.3%	-0.3%
11/18 08:50	JN	핵심기계수주 전월비	1.5%	--	-1.9%
11/19 19:00	EC	CPI (전년대비)	2.0%	--	2.0%
11/19 19:00	EC	CPI (전월대비)	0.3%	--	0.3%

일간 섹터별 수익률



주요 경제지표 추이



1) US=미국, SK=한국, UK=영국, AU=호주, JN=일본, CH=중국, FR=프랑스, GE=독일, EC=유로존

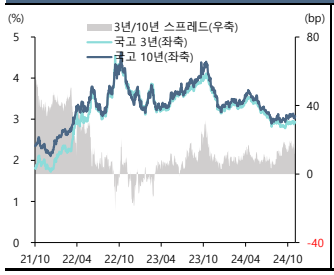
Fixed Income

국내 채권 (%, bp)	11/15	1D	1W	1M	3M	YTD
한국 CD(91일)	3.440	+0.0	+1.0	+5.0	-7.0	-39.0
한국 CP	3.530	+0.0	+2.0	+3.0	-7.0	-74.0
통안채 1년	2.858	+0.5	+3.1	-2.7	-16.4	-52.9
국고채 3년물	2.937	+1.0	+5.5	+2.2	+1.5	-20.8
국고채 5년물	2.990	+0.6	+5.3	+0.5	+5.1	-16.5
국고채 10년물	3.080	+0.5	+4.3	+0.0	+9.5	-9.5
한국 회사채 3년물(AA-)	3.501	+0.7	+5.1	+1.5	+6.5	-38.8
해외 채권 (%, bp)	**11/15**					
Libor 3M	4.854	-0.1	+0.0	+0.0	-9.8	-13.2
미 국채 2년물	4.303	-4.2	+4.9	+35.5	+32.0	+5.3
미 국채 10년물	4.439	+0.4	+13.5	+35.7	+63.3	+56.0
미 국채 30년물	4.617	+3.0	+14.7	+22.5	+55.6	+58.9
미국 회사채 IG	5.248	-1.5	+15.4	+31.0	+32.5	+18.9
미국 회사채 HY	7.477	-5.6	+14.0	+13.4	-17.0	-32.0
독 국채 10년물	2.356	+1.5	+2.9	+17.3	+14.1	+33.2

Currency

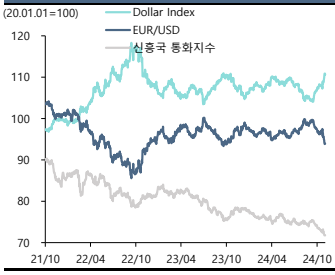
Global Market (pt, %)	11/15	1D	1W	1M	3M	YTD
Dollar Index	106.69	+0.18	+1.08	+3.09	+5.17	+5.28
EM 무역가중 Dollar Index	136.20	+0.73	+0.00	+1.40	+3.13	+7.68
신흥국 통화지수	44.107	-0.02	-0.46	-2.39	-4.34	-8.37
EURUSD	1.0530	-0.01	-1.17	-3.10	-5.39	-4.66
USDCNY	7.199	-0.03	+0.29	+1.01	+0.94	+1.64
USDJPY	154.35	-0.26	+0.41	+3.22	+6.26	+9.55
GBPUSD	1.2622	-0.04	-1.91	-3.29	-3.16	-0.83
AUDUSD	0.6464	-0.06	-1.69	-3.61	-4.17	-5.12
원화기준 (원, %)	**11/15**					
KRW/USD	1,399.5	-0.35	-0.11	+5.03	+5.03	+8.66
KRW/CNY	193.4	+0.01	-0.42	+3.62	+3.62	+6.33
KRW/EUR	1,475.1	-0.00	-1.17	-0.24	-0.24	+3.21
KRW/JPY	9.05	+0.11	-0.70	-1.07	-1.07	-1.53
KRW/GBP	1,764.2	-0.27	-2.14	+1.75	+1.75	+7.33
KRW/AUD	903.3	-0.25	-1.93	+0.64	+0.64	+2.72

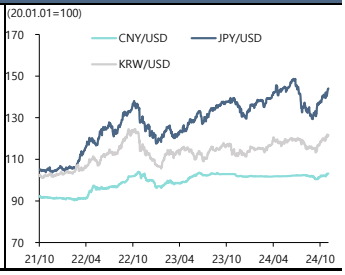
채권 수익률 동향





외환시장 동향





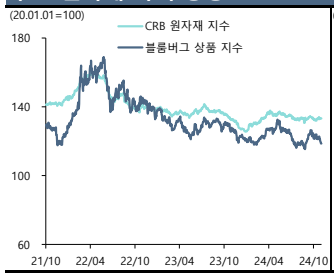
Commodity

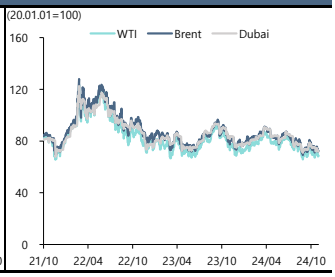
에너지(%)	11/15	1D	1W	1M	3M	YTD
WTI(NYM, USD/bbl)	67.02	-0.3	-1.5	-3.2	-9.5	-6.5
브렌트유(ICE, USD/bbl)	71.04	+0.4	-1.1	-2.8	-8.0	-7.8
천연가스HH(NYM, USD/MMBtu)	2.82	-0.8	-3.3	+25.0	+28.4	+12.3
천연가스TTF(ICE, EUR/Mwh)	46.55	+5.9	+6.5	+18.7	+22.6	+43.9
산업금속(%)						
리튬(NYM, USD/ton)	8,731.0	+0.0	+0.7	-8.7	-20.3	-47.3
구리(CMX, USD/lb)	406.5	-0.3	-3.9	-7.3	-2.3	+4.5
철광석(SGX, USD/ton)	99.4	+0.4	-2.3	-4.6	+2.3	-27.1
니켈(LME, USD/ton)	15,294.7	-0.7	-3.7	-8.6	-9.4	-6.9
알루미늄(LME, USD/ton)	2,626.1	-0.4	+2.9	+1.4	+5.7	+11.7
귀금속(%)						
금(CMX, USD/t.oz)	2,570.1	-0.1	-1.8	-5.3	+2.3	+24.1
은(CMX, USD/t.oz)	30.4	-0.3	-0.6	-8.4	+3.1	+26.3
백금(NYM, USD/t.oz)	945.1	-0.1	-2.5	-6.9	-1.1	-5.0
팔라듐(NYM, USD/t.oz)	943.3	+1.2	-4.0	-13.1	+3.1	-15.0
곡물(%)						
대두(CBT, Usc/bsh)	998.5	-2.0	-1.3	+2.9	+4.3	-22.8
옥수수(CBT, Usc/bsh)	424.0	-1.8	-1.4	+4.8	+13.1	-10.0
소맥(CBT, Usc/bsh)	536.5	-2.0	-5.1	-6.3	+0.7	-14.6
운임(pt, %)						
BDI	1,785.0	-0.2	+14.6	+13.3	+2.9	-14.8
SCFI	2,251.9	+1.2	-3.4	+9.2	-31.4	+28.0

ETF

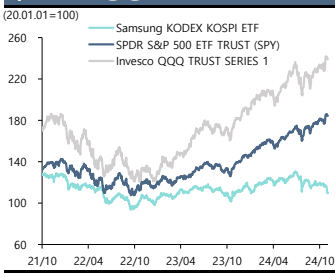
국내주식(원, %)	티커	11/15	1D	1W	1M	3M	YTD
KOSPI	226490	24,760	-0.7	-4.5	-6.8	-9.7	-7.2
KOSPI 200	102110	32,155	-0.2	-4.3	-7.5	-12.8	-9.4
KOSDAQ 150	229200	11,900	-0.7	-4.8	-6.0	-9.5	-14.5
해외주식(USD, %)							
S&P 500	SPY	585.8	-0.6	-2.2	+0.2	+5.2	+24.4
NASDAQ 100	QQQ	496.6	-0.7	-3.4	+0.4	+3.5	+21.8
Stoxx 50	FEZ	48.2	+0.9	-2.0	-6.9	-6.6	+3.3
CSI 300	ASHR	27.4	-2.1	-3.7	-1.5	+16.4	+14.5
국내채권(원, %)							
중장기 채권	302190	51,900	+0.0	-0.2	+0.1	+0.2	+3.2
단기 채권	214980	112,485	+0.0	+0.0	+0.2	+0.8	+3.2
종합 채권(AA-)	273130	114,460	+0.0	-0.2	+0.2	+0.5	+4.2
종합 채권(A-)	385540	114,460	+0.0	-0.2	+0.2	+0.5	+4.2
해외채권(USD, %)							
글로벌 채권	BNDX	50.0	+0.2	+0.1	-0.4	+0.7	+3.2
US 종합 채권	AGG	97.7	-0.0	-0.6	-1.6	-1.9	+1.5
US 종합 국채	GOVT	22.6	+0.0	-0.5	-1.6	-2.3	+0.8
US 물가연동채	TIP	107.5	-0.0	-0.7	-1.7	-1.1	+2.2
기타(USD, %)							
로보틱스&AI	BOTZ	32.1	-1.1	-5.0	+0.2	+3.9	+12.8
항공&방산	ITA	150.1	-3.1	-4.6	-3.1	+4.9	+19.2
캐시카우	COWZ	58.9	-0.1	-2.3	+0.2	+5.8	+14.9

주요 원자재 가격 동향





주요 ETF 동향





Compliance Notice
본 자료에 기재된 내용들은 작성자 본인의 의견을 정확하게 반영하고 있으며 외부의 부당한 압력이나 간섭 없이 작성되었음을 확인합니다.
본 자료는 고객의 증권투자를 돕기 위한 정보제공을 목적으로 제작되었습니다. 본 자료에 수록된 내용은 당사 리서치센터가 신뢰할 만한 자료 및 정보를 바탕으로 작성한 것이나, 당사가 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없으므로 참고자료로만 활용하시기 바라며 유가증권 투자 시 투자자 자신의 판단과 책임하에 최종결정을 하시기 바랍니다. 따라서 본 자료는 어떠한 경우에도 고객의 증권투자 결과에 대한 법적 책임소재의 증빙자료로 사용될 수 없습니다. 본 자료는 당사의 저작물로서 모든 저작권은 당사에게 있으며 어떠한 경우에도 당사의 동의 없이 복제, 배포, 전송, 변형될 수 없습니다. 동 자료는 제공시점 현재 기관투자가 또는 제3자에게 사전 제공한 사실이 없습니다.