상상인 Macro Daily

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

2024-08-29

Korea Market

Stock (pt, %)	08/28	1D	1W	1M	3M	YTD
KOSPI	2,689.8	+0.0	-0.4	-1.5	-1.2	+1.3
KOSDAQ	762.5	-0.3	-2.2	-4.4	-10.4	-12.0
반도체		+1.3	-3.5	-5.9	-5.8	+2.1
건강관리		+1.5	+2.8	+4.3	+18.7	+14.2
자동차		+2.7	+1.6	+0.0	-6.7	+6.4
화학		-2.5	-1.4	-5.8	-18.6	-31.4
소매(유통)		-1.2	-0.0	-2.1	-7.3	-6.9
미디어, 교육		+0.3	+1.5	-1.4	-13.8	-25.1
필수소비재		-0.9	+0.8	-0.0	+2.6	+8.1
거래대금 (평균, 십억원)	17,417	17,417	16,588	18,204		
외국인 순매수 (누적, 십억원)		-340	-1,355	-1,648		
기관 순매수 (누적, 십억원)		+253	+1,384	-775		
개인 순매수 (누적, 십억원)		+55	-81	+2,358		
Money Flow (십억원, Δ)	**08/27**					
주식형 펀드	118,114	+36	-138	-146	+5,478	+17,739
채권형 펀드	170,550	-63	+600	+4,254	+17,326	+35,997

Daily Comment

Stock Market

-KOSPI는 전일대비 0.02% 상승한 2,689.83pt에 마감. 외국인 투자자들의 순매도세에도 불구하고, 엔비디아의 2Q 실적 발표를 앞두고 어닝 서프라이즈 기대감이 반영된 반도체 섹터의 상승세에 힘입어 KOSPI는 강보합 마감

- S&P 500은 전일대비 0.60% 하락한 5,592.18pt에 마감. 장 마감 뒤 예정된 엔비디아의 실적 발표에 대한 경계심이 강화되는 모습. 시장은 위험을 회피하며 매도 우위 흐름이 나타남. 뉴욕증시는 하락 마감

Fixed Income

- 국고채 10년물 금리는 전일대비 1.5bp 하락한 3.050% 마감. 영국발 증세 계획 발표 및 2025년 한국 국채 발행량이 증가한 여파에도 불구하고, 외국인 투자자들의 순매수세가 유입되면서 강세장 시현. 다만 미국 고용 관련 심리가 약화된 점 역시 국고채 강세장을 지지

- 미 국채 10년물 금리는 전일대비 1.3bp 상승한 3.835%에 마감. 미 국채는 재료 부족 속에 촉매제가 될만한 새로운 지표를 기다리는 흐름. 금주 예정된 GDP 잠정치, PCE 물가지표를 대기하며 미 국채 금리는 소폭 상승

Currency

- 원/달러 환율은 전일대비 6.00원 상승한 달러당 1,337.0원에 마감. 원달러 환율은 엔비디아의 실적 발표에 대한 경계감 속에 장 후반부로 가면서 오름폭을 확대하는 모습. 위험 회피 심리가 나타나면 외국인 투자자들의 매도세가 출회. 원달러 환율은 상승 마감

- 달러 인덱스는 전일대비 0.50pt 상승한 101.06pt에 마감. 외환 시장에 영향을 미칠 재료가 부재한 가운데 시장은 이벤트를 대기. 파운드화를 중심으로 펼쳐졌던 달러 약세는 일시적으로 멈춘 흐름. 달

Commodity

- 금(10월물)은 전일대비 0.59% 하락한 온스당 2,514.3달러에 마감. 금 가격은 2거래일 연속 하락. 최근 금 가격이 높은 수준을 유지하자 차익실현 매물이 출회. 또한, 채권 금리의 상승과 달러의 강세는 금 가격 하방 압력으로 작용

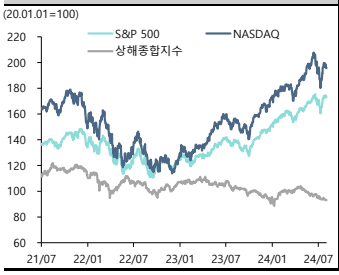
- WTI(10월물)은 전일대비 1.34% 하락한 배럴당 74.52달러에 마감. 리비아의 내정 갈등으로 인한 산유 중단으로 급등했던 유가는 재차 하락. 리비아의 중단 결정의 여파가 제한적일 것이라는 의견이 나오면서 유가 하방 압력으로 작용

Global Market

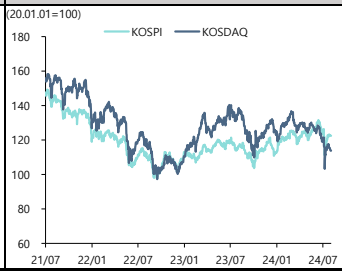
Stock (pt, %)	08/28	1D	1W	1M	3M	YTD
DOW	41,091.4	-0.4	+0.9	+0.9	+6.2	+9.0
S&P 500	5,592.2	-0.6	+0.4	+2.9	+6.0	+17.2
NASDAQ	17,556.0	-1.1	-0.4	+2.4	+4.9	+17.0
유로 STOXX 50	4,913.0	+0.3	+0.6	+1.5	-1.4	+8.7
영국 FTSE 100	8,343.9	-0.0	+0.7	+0.8	+0.8	+7.9
일본 NIKKEI 225	38,371.8	+0.2	+0.4	-0.4	-0.3	+14.7
중국 상해종합	2,837.4	-0.4	-0.4	-1.5	-8.1	-4.6
VIX 지수	17.1	+10.9	-2.5	-3.3	+32.4	+37.4
MOVE 지수	108.8	-0.4	+0.2	+8.3	+19.3	-5.1

주식시장동향

글로벌 주식



국내 주식



KOSPI 투자자별 매매동향

기관 수급

순매수 (십억원)		Daily	순매도 (십억원)	
두산에너빌리티	+22.5	1	현대로템	-9.5
삼성SDI	+11.3	2	LS ELECTRIC	-7.9
이수페타시스	+9.8	3	포스코퓨처엠	-7.8
삼성바이오로직스	+9.5	4	한국항공우주	-4.6
LG생활건강	+9.3	5	LG이노텍	-4.3
한화에어로스페이스	+7.2	6	삼성증권	-3.6
현대모비스	+7.1	7	한솔케미칼	-3.3

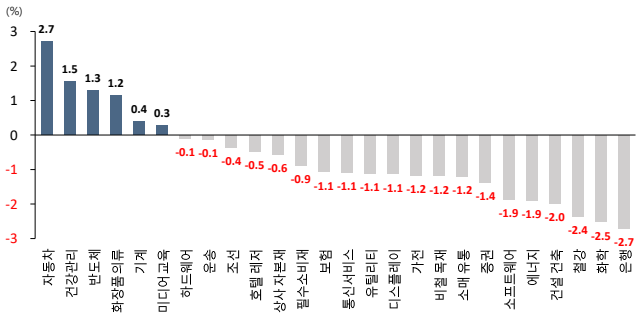
외국인 수급

순매수 (십억원)		Daily	순매도 (십억원)	
HD현대일렉트릭	+27.8	1	NAVER	-26.9
크래프톤	+11.6	2	POSCO홀딩스	-20.0
셀트리온	+8.0	3	LG화학	-18.3
우리금융지주	+6.9	4	하나금융지주	-18.0
LG이노텍	+6.7	5	한국가스공사	-5.8
SK바이오팜	+6.2	6	현대모비스	-5.1
종근당	+5.9	7	SKC	-4.7

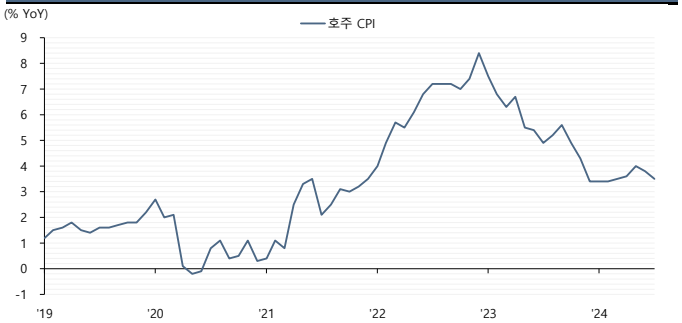
경제지표

DATE	국가	지표	예상	실제	이전
08/28 10:30	AU	CPI YoY	3.4%	3.5%	3.8%
08/28 17:00	EC	M3 통화공급 전년비	2.7%	2.3%	2.2%
08/28 20:00	US	MBA 주택융자 신청지수	--	0.5%	-10.1%
08/29 18:00	EC	소비자기대지수	--	--	-13.4
08/29 21:00	GE	CPI (전년대비)	2.1%	--	2.3%
08/29 21:00	GE	CPI (전월대비)	0.0%	--	0.3%
08/29 21:00	GE	CPI EU 종합 전월비	0.0%	--	0.5%
08/29 21:00	GE	CPI EU 종합 전년비	2.2%	--	2.6%
08/29 21:30	US	GDP 연간화 QoQ	2.8%	--	2.8%
08/29 21:30	US	개인소비	2.2%	--	2.3%
08/29 21:30	US	GDP 물가지수	2.3%	--	2.3%
08/29 21:30	US	근원 PCE 물가지수 QoQ	2.9%	--	2.9%
08/29 21:30	US	도매 재고 전월비	0.3%	--	0.2%
08/29 21:30	US	신규 실업수당 청구건수	232k	--	232k
08/29 21:30	US	실업보험연속수급신청자수	1870k	--	1863k
08/29 23:00	US	미결주택매매(전월대비)	0.2%	--	4.8%
08/30 08:00	SK	광공업생산 YoY	7.5%	--	3.8%

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

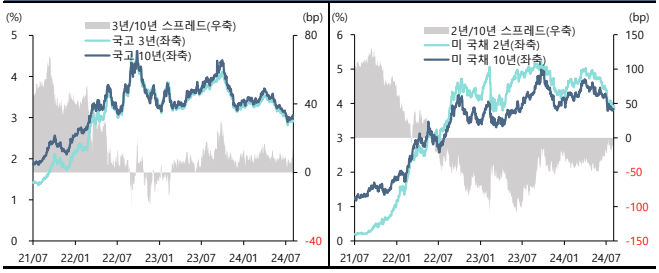
Fixed Income

국내 채권 (%, bp)	08/28	1D	1W	1M	3M	YTD
한국 CD(91일)	3.520	+0.0	+0.0	+2.0	-8.0	-31.0
한국 CP	3.590	+0.0	+0.0	-34.0	-59.0	-68.0
통안채 1년	3.031	-0.9	+2.0	-11.7	-36.2	-35.6
국고채 3년물	2.915	-2.0	-2.5	-5.7	-52.5	-23.0
국고채 5년물	2.972	-1.7	+1.1	-1.4	-51.8	-18.3
국고채 10년물	3.050	-1.5	+5.3	+0.8	-51.2	-12.5
한국 회사채 3년물(AA-)	3.465	-0.9	+0.7	+3.5	-39.6	-42.4
해외 채권 (%, bp)	**08/28**					
Libor 3M	5.324	-1.9	-0.2	-3.4	-5.0	-4.8
미 국채 2년물	3.865	-3.4	-13.9	-49.4	-100.8	-38.5
미 국채 10년물	3.835	+1.3	-1.7	-30.5	-66.4	-4.4
미 국채 30년물	4.125	+1.2	-0.1	-27.0	-52.2	+9.7
미국 회사채 IG	4.877	-0.9	-6.5	-35.4	-64.2	-18.2
미국 회사채 HY	7.539	+0.2	-8.2	-30.8	-63.7	-25.8
독 국채 10년물	2.261	-2.7	+1.7	-7.9	-40.3	+23.7

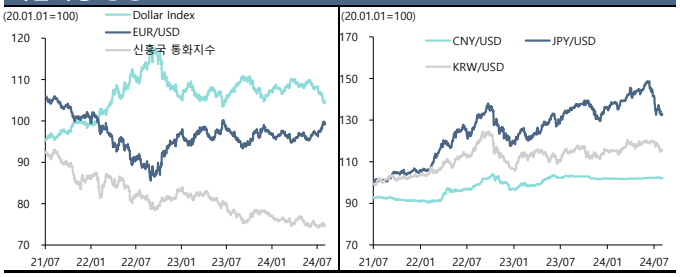
Currency

Global Market (pt, %)	08/28	1D	1W	1M	3M	YTD
Dollar Index	101.05	+0.50	-0.45	-3.35	-3.46	-0.28
EM 무역가중 Dollar Index	132.36	-0.81	-0.81	-1.24	+1.88	+4.64
신흥국 통화지수	45.871	-0.24	+0.18	+0.30	-1.69	-4.71
EURUSD	1.1120	+0.00	+0.07	+2.82	+2.51	+0.68
USDCNY	7.122	-0.05	-0.02	-0.21	+0.18	+0.55
USDJPY	144.46	+0.09	-1.25	-5.44	-8.17	+2.53
GBPUSD	1.3191	+0.00	+0.76	+2.77	+3.52	+3.65
AUDUSD	0.6784	-0.01	+1.18	+3.76	+1.97	-0.43
원화기준 (원, %)	**08/28**					
KRW/USD	1,337.0	-0.45	-0.48	-3.43	-3.43	+3.80
KRW/CNY	187.5	-0.34	-0.27	-2.01	-2.01	+3.10
KRW/EUR	1,485.3	+0.07	-0.47	-0.84	-0.84	+3.92
KRW/JPY	9.25	+0.02	+0.73	+5.11	+5.11	+0.59
KRW/GBP	1,762.8	+0.00	+0.26	-0.16	-0.16	+7.25
KRW/AUD	906.6	+0.01	+0.67	-1.66	-1.66	+3.09

채권 수익률 동향



외환시장 동향



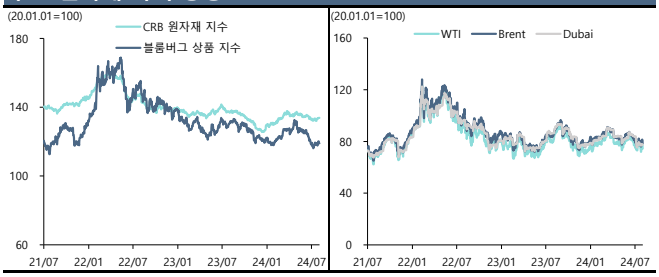
Commodity

에너지(%)	08/28	1D	1W	1M	3M	YTD
WTI(NYM, USD/bbl)	74.52	-1.3	+2.1	-0.3	-3.2	+4.0
브렌트유(ICE, USD/bbl)	78.46	-1.4	+1.6	-0.2	-3.9	+1.8
천연가스HH(NYM, USD/MMBtu)	1.93	+0.6	-6.0	-9.2	-25.4	-23.2
천연가스TTF(ICE, EUR/Mwh)	38.52	-0.4	+5.3	+12.1	+12.6	+19.1
산업금속(%)						
리튬(NYM, USD/ton)	10,948.6	+0.2	+0.2	-8.6	-22.7	-34.0
구리(CMX, USD/lb)	415.0	-2.1	+0.0	+1.6	-9.8	+6.7
철광석(SGX, USD/ton)	98.8	+1.1	+0.9	-6.7	-15.9	-27.6
니켈(LME, USD/ton)	16,845.4	+2.2	+2.5	+6.2	-13.7	+2.5
알루미늄(LME, USD/ton)	2,543.1	-0.0	+2.8	+17.0	-3.0	+8.1
귀금속(%)						
금(CMX, USD/t.oz)	2,501.0	-0.6	+0.9	+4.0	+7.7	+20.7
은(CMX, USD/t.oz)	29.2	-2.6	+0.5	+2.4	-4.1	+21.2
백금(NYM, USD/t.oz)	937.3	-2.6	-1.7	-3.5	-10.0	-5.8
팔라듐(NYM, USD/t.oz)	933.9	-2.6	+1.5	+5.9	+3.9	-15.8
곡물(%)						
대두(CBT, Usc/bsh)	958.5	-0.9	+1.8	-6.7	-20.5	-25.9
옥수수(CBT, Usc/bsh)	365.3	-0.5	-1.7	-6.0	-18.2	-22.5
소맥(CBT, Usc/bsh)	514.3	+1.2	+0.6	-1.9	-24.2	-18.1
운임(pt, %)						
BDI	1,721.0	-2.3	-2.7	-2.3	-5.2	-17.8
SCFI	3,097.6	-5.6	-5.6	-10.2	+1.7	+76.0

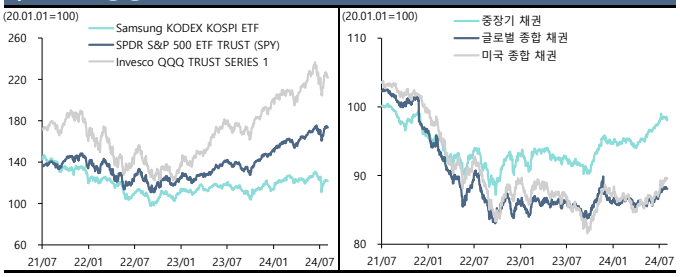
ETF

국내주식(원, %)	티커	08/28	1D	1W	1M	3M	YTD
KOSPI	226490	27,380	+0.1	-0.5	-1.6	+2.1	+0.4
KOSPI 200	102110	36,630	+0.1	-1.0	-2.7	+1.6	+0.9
KOSDAQ 150	229200	12,765	+0.0	-1.0	-4.7	-3.9	-8.4
해외주식(USD, %)							
S&P 500	SPY	558.3	-0.6	+0.4	+3.0	+5.9	+17.5
NASDAQ 100	QQQ	471.4	-1.1	-0.7	+3.0	+4.6	+15.1
Stoxx 50	FEZ	52.3	-0.4	+1.1	+4.6	-1.3	+9.3
CSI 300	ASHR	23.2	-1.0	-0.6	-0.7	-5.0	-3.2
국내채권(원, %)							
중장기 채권	302190	51,705	+0.1	-0.3	+0.3	+3.4	+2.8
단기 채권	214980	111,675	-0.0	+0.0	+0.2	+0.9	+2.4
종합 채권(AA-)	273130	113,565	+0.2	-0.3	+0.1	+3.3	+3.4
종합 채권(A-)	385540	113,565	+0.2	-0.3	+0.1	+3.3	+3.4
해외채권(USD, %)							
글로벌 채권	BNDX	49.8	-0.0	+0.0	+0.8	+2.8	+0.9
US 종합 채권	AGG	100.6	-0.1	+0.3	+2.1	+4.2	+1.4
US 종합 국채	GOVT	23.3	-0.0	+0.2	+2.0	+4.1	+1.3
US 물가연동채	TIP	109.4	-0.0	+0.5	+1.7	+2.5	+1.7
기타(USD, %)							
로보틱스&AI	BOTZ	31.3	-1.2	+0.6	+5.1	+1.7	+9.9
항공&방산	ITA	145.3	+0.4	+0.9	+2.6	+6.8	+14.8
캐시카우	COWZ	57.2	-0.3	+1.5	-0.8	+1.8	+10.0

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.