

상상인 Macro Daily

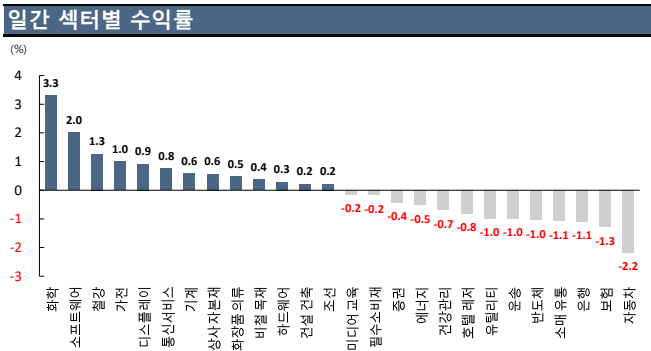
투자전략팀 / 신일, 황준호, 김현성, 최예찬 / 02 3779 3186 / jh.hwang@sangsanginib.com

2024-02-16

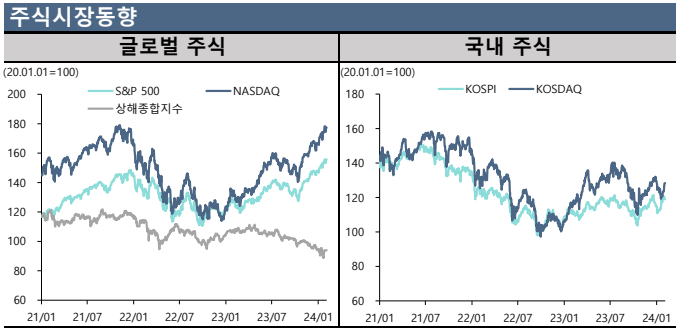
Korea Market						
Stock (pt, %)	02/15	1D	1W	1M	3M	YTD
KOSPI	2,613.8	-0.3	-0.3	+3.5	+5.1	-1.6
KOSDAQ	859.2	+0.7	+4.0	-0.1	+6.2	-0.9
반도체		-1.0	+0.1	+1.9	+4.2	-3.7
건강관리		-0.7	+1.2	-0.2	+7.0	-5.3
자동차		-2.2	-1.4	+17.9	+22.1	+9.4
화학		+3.3	+2.3	+3.6	-3.3	-5.2
소매(유통)		-1.1	-3.4	+2.7	-1.0	-1.0
미디어, 교육		-0.2	+2.6	-3.4	-4.5	-6.4
필수소비재		-0.2	-1.1	-3.4	-6.3	-4.8
거래대금 (평균, 십억원)	21,627	21,627	21,328	19,959		
외국인 순매수 (누적, 십억원)		-16	+1,447	+6,498		
기관 순매수 (누적, 십억원)		-48	+211	+774		
개인 순매수 (누적, 십억원)		+33	-1,682	-7,180		
Money Flow (십억원, Δ)						
주식형 펀드	107,231	+854	+1,865	+4,446	+5,693	+11,199
채권형 펀드	143,847	+299	+951	+5,985	+8,944	+23,207

Global Market						
Stock (pt, %)	02/15	1D	1W	1M	3M	YTD
DOW	38,773.1	+0.9	+0.3	+4.0	+10.9	+2.9
S&P 500	5,029.7	+0.6	+0.1	+6.1	+11.4	+5.4
NASDAQ	15,906.2	+0.3	-0.5	+7.1	+12.6	+6.0
유로 STOXX 50	4,743.2	+0.7	+0.6	+7.7	+9.3	+4.9
영국 FTSE 100	7,597.5	+0.4	+0.3	+2.0	+1.2	-1.8
일본 NIKKEI 225	38,157.9	+1.2	+3.4	+7.6	+13.6	+14.0
중국 상해종합	2,865.9	+1.3	+0.0	+1.1	-6.2	-3.7
VIX 지수	14.0	-2.6	+8.4	-5.3	+1.5	+12.5
MOVE 지수	112.1	-1.1	+5.5	+5.9	-0.9	-2.2

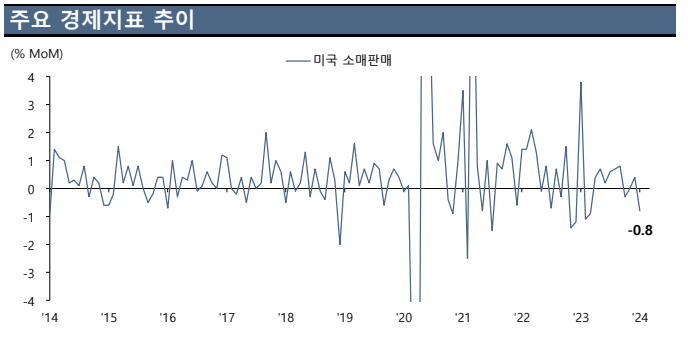
KOSPI 투자자별 매매동향			
기관 수급			
순매수 (십억원)	Daily	순매도 (십억원)	
카카오	+66.9	1 삼성전자	-150.7
LG화학	+52.2	2 기아	-23.5
LG생활건강	+29.1	3 한미반도체	-15.6
KB금융	+20.3	4 삼성물산	-10.2
POSCO홀딩스	+16.2	5 LG이노텍	-9.2
신한지주	+11.0	6 삼성전기	-8.0
쌍용C&E	+10.2	7 삼성중공업	-5.8
외국인 수급			
순매수 (십억원)	Daily	순매도 (십억원)	
카카오	+75.6	1 NAVER	-18.8
삼성물산	+51.6	2 LG화학	-10.1
LG에너지솔루션	+12.3	3 현대미포조선	-5.2
금양	+9.7	4 대한항공	-4.9
SK하이닉스	+6.9	5 오리온	-4.5
한전KPS	+5.8	6 HD현대건설기계	-3.7
SK	+5.1	7 이수페타시스	-3.4



Daily Comment	
Stock Market	Fixed Income
- KOSPI는 전일대비 0.25% 하락한 2,613.8pt에 마감. 현대차, 기아 등 저PBR 종목들에 대한 조정장이 실현되면서 KOSPI는 전일대비 하락 마감. 반면 KOSDAQ은 AI 테마에 대한 기대감으로 인해 S/W 종목들을 중심으로 상승세를 실현	- 국고채 10년물 금리는 전일대비 1.5bp 하락한 3.480%에 마감. 전일 반발 매수세가 유입되며 강세장이 실현된 미국채 시장에 연동된 가운데, 호주 고용지표 부진으로 인해 안전자산 선호심리가 강화되면서 국고채 금리는 하락 마감
- S&P 500은 전일대비 0.58% 상승한 5,029.73pt에 마감. 미국 소매판매는 예상보다 큰 폭으로 하락한 가운데 엔비디아 투자회사 및 협력업체 주가가 최대 67%까지 폭등하는 등 중소형 AI로 투심이 이동. 이에 뉴욕 증시는 상승 마감	- 미 국채 10년물 금리는 전일대비 1.4bp 하락한 4.242%에 마감. 1월 미국 소매판매가 자동차 판매 부진, 북극 한파, 계절적 요인들의 영향으로 전월대비 -0.8%를 기록하며 예상치 -0.2%를 크게 하회함에 따라 CPI 충격에서 비롯된 금리 인하 지연 우려가 일부 상쇄
Currency	Commodity
- 원/달러 환율은 전일대비 1.4원 하락한 1,334.0원에 마감. 골드미 시카고 연은 총채의 인플레이션 둔화를 시사하는 발언으로 인해 1월 CPI 쇼크로 인한 달러 강세가 진정되면서 원/달러 환율은 전일대비 상승 마감	- 금(3월물)은 전일대비 0.59% 상승한 온스당 2,002.1달러에 마감. 국제금리와 달러가치의 하락이 지속된 가운데 후티 반군의 영국 선박에 대한 미사일 공격 소식에 금 가격 상승 마감
- 달러 인덱스는 전일대비 0.44pt 하락한 104.28pt에 마감. 미국 소매판매가 전월대비 크게 감소하면서 견조했던 CPI와 상반된 결과에 달러 약세 모멘텀을 바탕으로 하락 마감	- WTI(3월물)는 전일대비 2.00% 상승한 배럴당 78.17달러에 마감. 미국 소매판매 부진이 달러 약세를 촉발한 가운데 IEA가 올해 세계 원유 수요의 120만b/d 증가 전망을 유지하면서 유가는 2% 상승



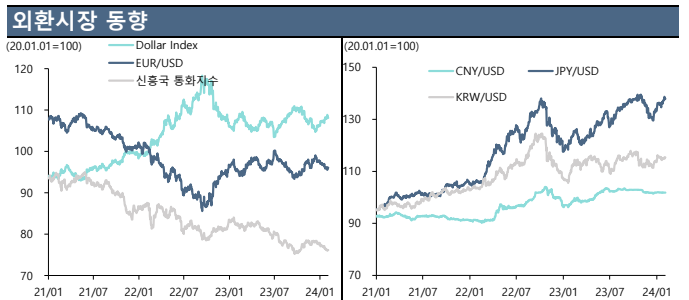
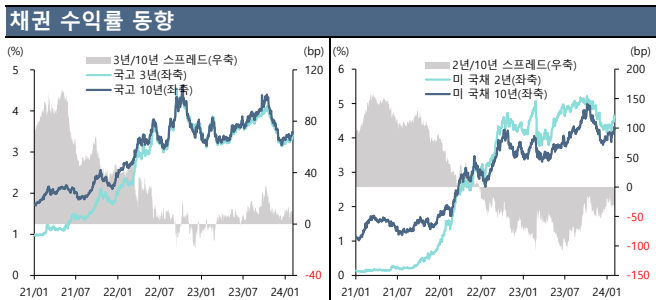
경제지표					
DATE	국가	지표	예상	실제	이전
02/15 08:50	JN	GDP 연간화 SA 전분기대비	1.1%	-0.4%	-2.9%
02/15 08:50	JN	GDP SA (전기대비)	0.2%	-0.1%	-0.7%
02/15 22:30	US	소매판매 추정 전월비	-0.2%	-0.8%	0.6%
02/15 22:30	US	소매 판매 (자동차 제외) 전월비	0.2%	-0.6%	0.4%
02/15 22:30	US	소매 판매 (자동차 및 가스 제외)	0.2%	-0.5%	0.6%
02/15 22:30	US	신규 실업수당 청구건수	220k	212k	218k
02/15 22:30	US	실업보험연속수급신청자수	1880k	1895k	1871k
02/15 23:15	US	광공업생산 MoM	0.2%	-0.1%	0.1%
02/15 23:15	US	설비가동률	78.8%	78.5%	78.6%
02/16 00:00	US	NAHB 주택시장지수	46	48	44
02/16 22:30	US	주택착공건수	1460k	--	1460k
02/16 22:30	US	건축허가	1512k	--	1495k
02/16 22:30	US	PPI 최종수요 MoM	0.1%	--	-0.1%
02/17 00:00	US	미시간대학교 소비자신뢰	80	--	79
02/17 00:00	US	미시간대학교 소비자기대	77	--	77.1
02/17 00:00	US	미시간대학교 1년 인플레이션	2.9%	--	2.9%
02/17 00:00	US	미시간대학교 5-10년 인플레이션	2.8%	--	2.9%



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

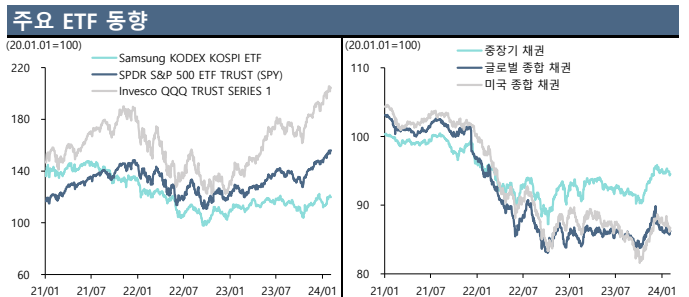
Fixed Income						
국내 채권 (% , bp)	02/15	1D	1W	1M	3M	YTD
한국 CD(91일)	3.680	+0.0	+1.0	-4.0	-15.0	-15.0
한국 CP	4.230	+0.0	+0.0	+0.0	-8.0	-4.0
통안채 1년	3.390	-0.3	+3.9	+11.7	-29.0	+0.3
국고채 3년물	3.407	-0.7	+10.3	+17.6	-27.8	+26.2
국고채 5년물	3.445	-1.0	+10.5	+18.0	-27.5	+29.0
국고채 10년물	3.480	-1.5	+7.5	+16.5	-32.5	+30.5
한국 회사채 3년물(AA-)	4.104	-1.0	+8.5	+12.3	-37.1	+21.5
해외 채권 (% , bp)						
Libor 3M	5.587	+1.9	+0.3	+0.3	-0.7	-0.1
미 국채 2년물	4.576	+0.5	+9.6	+21.5	-30.9	+32.6
미 국채 10년물	4.232	-1.4	+5.7	+13.0	-20.3	+35.3
미 국채 30년물	4.411	-1.4	+3.8	+9.9	-17.8	+38.2
미국 회사채 IG	5.394	+11.5	+8.0	+15.4	-43.3	+33.4
미국 회사채 HY	8.054	+2.6	+11.9	-2.0	-76.2	+25.6
독 국채 10년물	2.359	+2.2	-2.3	+4.3	-22.9	+33.5

Currency						
Global Market (pt, %)	02/15	1D	1W	1M	3M	YTD
Dollar Index	104.29	-0.42	+0.17	+0.81	+0.36	+2.91
EM 무역가중 Dollar Index	128.55	-0.06	+0.00	-0.34	+0.77	+1.63
신흥국 통화지수	46.784	-0.02	-0.12	-1.16	-2.30	-2.81
EURUSD	1.0772	+0.41	-0.11	-1.02	-1.31	-2.47
USDCNY	7.104	-0.04	+0.00	-0.19	-0.96	+0.30
USDJPY	149.93	+0.41	+0.43	+1.19	+0.20	+6.42
GBPUSD	1.2598	+0.24	-0.24	-0.62	+1.09	-1.01
AUDUSD	0.6524	+0.51	+0.00	-0.43	+0.14	-4.24
원화기준 (원, %)						
KRW/USD	1,334.0	+0.10	+0.44	+2.86	+2.86	+3.57
KRW/CNY	185.4	-0.10	+0.13	+3.18	+3.18	+1.98
KRW/EUR	1,430.8	+0.02	-0.35	+1.97	+1.97	+0.10
KRW/JPY	8.87	-0.32	-0.62	+2.37	+2.37	-3.54
KRW/GBP	1,680.6	-0.14	-0.18	+4.01	+4.01	+2.25
KRW/AUD	870.3	-0.39	+0.06	+3.04	+3.04	-1.03



Commodity						
에너지(%)	02/15	1D	1W	1M	3M	YTD
WTI(NYM, USD/bbl)	78.20	+2.0	+1.8	+7.8	+3.0	+9.1
브렌트유(ICE, USD/bbl)	82.84	+1.6	+0.8	+6.4	+2.8	+7.5
천연가스HH(NYM, USD/MMBtu)	1.59	-1.2	-14.0	-44.6	-46.3	-36.8
천연가스TTF(ICE, EUR/Mwh)	24.97	+0.4	-7.9	-9.9	-44.6	-22.8
산업금속(%)						
리튬(NYM, USD/ton)	13,250.0	+0.0	+0.0	-10.7	-37.6	-20.1
구리(CMX, USD/lb)	375.9	+1.6	+2.1	+0.7	+0.5	-3.4
철광석(SGX, USD/ton)	130.0	+1.0	+1.5	-1.5	+0.5	-4.7
니켈(LME, USD/ton)	16,105.0	+0.5	+2.6	+1.2	-3.8	-2.0
알루미늄(LME, USD/ton)	2,214.3	+0.6	+1.1	+2.8	+1.4	-5.8
귀금속(%)						
금(CMX, USD/t.oz)	2,002.1	+0.6	-1.0	-0.2	+0.9	-3.4
은(CMX, USD/t.oz)	23.0	+2.6	+1.7	+1.3	-3.7	-4.6
백금(NYM, USD/t.oz)	905.8	+1.0	+3.1	+2.6	+0.5	-9.0
팔라듐(NYM, USD/t.oz)	956.5	+2.4	+10.0	+4.0	-9.7	-13.8
곡물(%)						
대두(CBT, Usc/bsh)	1,163.0	-0.6	-1.7	-3.5	-13.2	-10.1
옥수수(CBT, Usc/bsh)	417.8	-1.5	-2.6	-5.5	-10.5	-11.4
소맥(CBT, Usc/bsh)	565.5	-3.4	-5.2	-2.9	+2.7	-10.0
운임(pt, %)						
BDI	1,582.0	-0.2	+2.4	+20.9	-13.1	-24.5
SCFI	2,166.3	-2.3	+0.0	-1.8	+116.6	+23.1

ETF							
국내주식(원, %)	티커	02/15	1D	1W	1M	3M	YTD
KOSPI	226490	26,910	-0.3	-0.2	+7.1	+7.0	-1.3
KOSPI 200	102110	35,465	-0.1	-0.4	+7.5	+6.4	-2.3
KOSDAQ 150	229200	13,455	+0.4	+3.3	+2.9	+7.3	-3.5
해외주식(USD, %)							
S&P 500	SPY	502.0	+0.7	+0.2	+6.3	+11.4	+5.6
NASDAQ 100	QQQ	434.5	+0.3	-0.6	+6.7	+12.6	+6.1
Stoxx 50	FEZ	49.1	+1.2	+0.5	+7.2	+8.3	+2.7
CSI 300	ASHR	23.1	+0.5	+0.9	+4.6	-8.4	-3.2
국내채권(원, %)							
중장기 채권	302190	49,775	+0.2	-0.4	-0.3	+1.5	-1.0
단기 채권	214980	109,570	+0.0	+0.0	+0.3	+1.1	+0.5
종합 채권(AA-)	273130	109,000	+0.3	-0.1	-0.0	+2.6	-0.8
종합 채권(A-)	385540	109,000	+0.3	-0.1	-0.0	+2.6	-0.8
해외채권(USD, %)							
글로벌 채권	BNDX	48.8	-0.0	+0.3	+0.1	-0.2	-1.2
US 종합 채권	AGG	97.4	+0.2	-0.2	-0.7	+2.3	-1.9
US 종합 국채	GOVT	22.6	+0.2	-0.3	-0.8	+1.6	-1.8
US 물가연동채	TIP	106.3	+0.1	-0.1	-0.6	+1.7	-1.1
기타(USD, %)							
로보틱스&AI	BOTZ	30.1	+0.8	+0.8	+7.1	+16.6	+5.8
항공&방산	ITA	126.2	+0.7	+1.3	+5.8	+9.1	-0.3
캐시카우	COWZ	53.2	+1.8	+2.0	+4.8	+7.1	+2.3



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 기관투자자 또는 제3자에게 사전 제공한 사실이 없습니다.